

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

РАССМОТРЕНО И ОДОБРЕНО

УТВЕРЖДАЮ

На заседании кафедры менеджмента  
и государственного и  
муниципального управления  
Протокол № 10 от 24.05.2023 г.

Первый проректор  
С.В. Авдашкевич  
28.06.2023

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина:	Б1.В.09 Риск-менеджмент
Направление подготовки:	38.03.02 Менеджмент
Направленность (профиль):	Проектный менеджмент
Уровень высшего образования:	Бакалавриат
Форма обучения:	очная, заочная, очно-заочная
Разработчики:	Кандидат экономических наук, доцент Клюев К.В.

Санкт-Петербург  
2023

**1. Цели и задачи дисциплины:***Цель освоения дисциплины:*

освоение студентами теоретических знаний в области моделирования экономических процессов в условиях риска, приобретение навыков принятия управленческих решений в ситуациях связанных с риском, способность проводить анализ рисков и использовать его результаты для принятия управленческих решений.

*Задачи дисциплины:*

изучение сущности понятия риска в целом и экономического риска, в частности, классификацию рисков, методы оценки и прогнозирования рисков, понятие системы управления рисками (риск-менеджмент);

иметь представление о формировании рисков, их оценке, а также уметь управлять рисками проекта.

**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-2 Способен составлять финансовый план реализации инвестиционного проекта, обеспечивать его исполнение	ПК-2.1 Знает методы планирования финансово-хозяйственной деятельности, способы управления финансовыми потоками и принципы бюджетирования в рамках реализации инвестиционного проекта	08.036 Профессиональный стандарт «Специалист по работе с инвестиционными проектами»
	ПК-2.2 Умеет рассчитывать период окупаемости проекта, формировать плановые значения ключевых показателей инвестиционного проекта	
	ПК-2.3 Способен проводить оценку устойчивости проекта к изменяющимся условиям внешней и внутренней среды, осуществлять прогнозирование доходов и расходов, рассчитывать срок окупаемости и потребность в кредитных ресурсах при составлении бюджета проектов и построении финансовой модели	
ПК-3 Способен анализировать возможные риски, принимать стратегические решения в рамках реализации инвестиционного проекта в зависимости от факторов внешней и внутренней среды	ПК-3.1 Знает основы стратегического менеджмента, основные факторы риска, их количественную оценку в рамках реализации инвестиционного проекта	08.036 Профессиональный стандарт «Специалист по работе с инвестиционными проектами»
	ПК-3.2 Умеет разрабатывать меры по снижению воздействия основных факторов риска на результаты эффективности проекта, выбирать вариант инвестиционного проекта, принимать инвестиционное решение	
	ПК-3.3 Способен проводить оценку рисков проекта, оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся ключевым параметрам внешней и внутренней среды.	

Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-2.1. Знает методы планирования финансово-хозяйственной деятельности, способы управления финансовыми потоками и принципы бюджетирования в рамках реализации инвестиционного проекта	Знать основные методы финансового менеджмента для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала.
ПК-2.2. Умеет рассчитывать период окупаемости проекта, формировать плановые значения ключевых показателей инвестиционного проекта	Уметь применять навыки самостоятельной работы при изучении учебной литературы в сфере финансового менеджмента для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала.

Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-2.3. Способен проводить оценку устойчивости проекта к изменяющимся условиям внешней и внутренней среды, осуществлять прогнозирование доходов и расходов, рассчитывать срок окупаемости и потребность в кредитных ресурсах при составлении бюджета проектов и построении финансовой модели	Владеть навыками самостоятельной работы при изучении учебной литературы, необходимой для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала.
ПК-3.1. Знает основы стратегического менеджмента, основные факторы риска, их количественную оценку в рамках реализации инвестиционного проекта	Знать систему показателей, характеризующих эффективность управленческих решений в сфере инвестиционных решений.
ПК-3.2. Умеет разрабатывать меры по снижению воздействия основных факторов риска на результаты эффективности проекта, выбирать вариант инвестиционного проекта, принимать инвестиционное решение	Уметь использовать теоретические данные, связанные с основными показателями деятельности фирмы, необходимыми для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала.
ПК-3.3. Способен проводить оценку рисков проекта, оценку устойчивости инвестиционного проекта к изменяющимся ключевым параметрам внешней и внутренней среды.	Владеть способностью самостоятельно осваивать прикладные экономические знания, необходимые для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала.

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

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Компетенции	Оценочные средства текущего контроля		
			ЗНАТЬ	УМЕТЬ	ВЛАДЕТЬ
			ПК-2.1 ПК-3.1	ПК-2.2 ПК-3.2	ПК-2.3 ПК-3.3
1	Понятие риска в экономике	ПК-2 ПК-3	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №1 (10)	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
2	Место и роль риск-менеджмента в экономике предприятия	ПК-2 ПК-3	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №1 (10)	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
3	Организация моделирования рисков проекта.	ПК-2 ПК-3	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №1 (20)	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
4	Система операционных риск-индикаторов хозяйствующих субъектов	ПК-2 ПК-3	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №1 (20)	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №2 (20)
5	Управление рисками	ПК-2 ПК-3	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №2 (20)	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
6	Методы анализа и показатели оценки риска	ПК-2 ПК-3	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №2 (20)	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №2 (20)
<b>Количество баллов (100 баллов):</b>			100		

<b>Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа</b>		
<p><b>Тема 1: Понятие риска в экономике</b> Риск, его понятие, сущность. Вероятностный характер риска. Объективный характер возникновения риска и субъективность его оценки. Значение риска в предпринимательской деятельности. Понятие экономического риска. Основные черты, присущие экономическому риску. Историческое развитие взглядов ведущих экономистов на понятие риска. Основные научные концепции риска. Классическая и неоклассическая теория предпринимательских рисков. Классическое понимание риска как возможности возникновения потерь (ущерба) от предпринимательской деятельности. Величина прибыли и ее колебания как основы неоклассической теории предпринимательских рисков.</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Управление риском – новая отрасль знания и самостоятельный вид профессиональной деятельности .</p> <p><b>Лабораторная работа: -</b></p>		
<p><b>Тема 2: Место и роль риск-менеджмента в экономике предприятия</b> Зависимость неопределенности внешней среды функционирования и эффективности предпринимательской деятельности. Общий график «риск-прибыль». Задачи риск-менеджмента (выявление, оценка, анализ, управление рисками и пр.). Неразрывность зависимости стратегии и тактики риск-менеджмента.</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Становление и развитие риск - менеджмента как научной дисциплины.</p> <p><b>Лабораторная работа: -</b></p>		
<p><b>Тема 3: Организация моделирования рисков проекта.</b> Место и роль подразделения по управлению рисками проекта в системе корпоративного управления предприятия. Зависимость его организационно-штатной структуры от размера и профиля деятельности предприятия.</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Факторы, способствующие повышению роли риск - менеджмента.</p> <p><b>Лабораторная работа: -</b></p>		
<p><b>Тема 4: Система операционных риск-индикаторов хозяйствующих субъектов</b> Система операционных риск-индикаторов предприятия: понятие, значение, задачи. Основные принципы формирования риск-индикаторов хозяйственных процессов. Риск-индикаторы блока «Проект». Обеспеченность ресурсами. Сравнительный уровень затрат на прирост прогнозных ресурсов. Сравнительный уровень затрат проект.</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Процесс управления риском. Содержание и цели каждого этапа управления.</p> <p><b>Лабораторная работа: -</b></p>		
<p><b>Тема 5: Управление рисками</b> Основные методы управления рисками, их характеристика. Страхование как метод управления рисками предприятия. Историческое развитие института страхования. Основные понятия (термины), применяемые в страховании (страховщик, страхователь, страховой тариф, страховая премия, франшиза и пр.). Полное и частичное страхование рисков. Пропорциональное и непропорциональное частичное страхование рисков. Основные преимущества страхования как метода управления риском. Объективные и субъективные недостатки страхования как метода управления риском. Критерии выбора страховой компании.</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Концепция приемлемости риска. Процедуры реализации концепции.</p> <p><b>Лабораторная работа: -</b></p>		
<p><b>Тема 6: Методы анализа и показатели оценки риска</b> Диалектика как метод анализа и управления риском. Качественный и количественный анализ риска. Измерение риска. Вероятность как показатель риска. Абсолютные и относительные характеристики риска. Экспертные и статистические методы анализа риска и оценки его существенности. Применение теории стратегических игр в управлении риском. Финансовые решения в условиях риска. Анализ финансовых коэффициентов и безубыточности предприятия. Зона и уровень безубыточности.</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Определение и основные виды инвестиционных рисков.</p> <p><b>Лабораторная работа: -</b></p>		
<p><b>Курсовая работа:</b> не предусмотрено учебным планом</p>		

*Очная форма обучения*

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 5
Аудиторные занятия (АЗ):	90	90
Лекционные занятия (Лек)	36	36
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 5
Практические занятия (Пр)	54	54
Самостоятельная работа студента (СР)	90	90
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	90	90
Контроль самостоятельной работы (КСР)	9	9
Контактная работа (КоР)	99	99
Форма промежуточной аттестации	0	Экзамен
Подготовка к экзамену и сдача экзамена (СР, КоР)	27	27
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	216/6	216/6

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

№	Наименование темы дисциплины	Семестр/ Курс	Количество учебных часов				СР	Практическая подготовка
			В том числе по видам аудиторных занятий					
			Лек	Пр	Лаб			
1	Понятие риска в экономике	5	6	8	0	15	8	
2	Место и роль риск-менеджмента в экономике предприятия	5	6	8	0	15	8	
3	Организация моделирования рисков проекта.	5	6	8	0	15	8	
4	Система операционных риск-индикаторов хозяйствующих субъектов	5	6	10	0	15	10	
5	Управление рисками	5	6	10	0	15	10	
6	Методы анализа и показатели оценки риска	5	6	10	0	15	10	
		Итого:	36	54	0	90	54	

\* 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 6
Аудиторные занятия (АЗ):	14	14
Лекционные занятия (Лек)	6	6
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	8	8
Самостоятельная работа студента (СР)	184	184
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	184	184
Контроль самостоятельной работы (КСР)	9	9
Контактная работа (КоР)	23	23
Форма промежуточной аттестации	0	Экзамен
Подготовка к экзамену/зачету и сдача экзамена/зачета (СР, КоР)	9	9
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	216/6	216/6

\* Подготовка к аудиторным занятиям

№	Наименование темы дисциплины	Семестр/ Курс	Количество учебных часов				СР	Практическая подготовка
			В том числе по видам аудиторных занятий					
			Лек	Пр	Лаб			
1	Понятие риска в экономике	6	2	0	0	30	8	
2	Место и роль риск-менеджмента в экономике предприятия	6	2	0	0	30	8	
3	Организация моделирования рисков проекта.	6	2	2	0	31	8	
4	Система операционных риск-индикаторов хозяйствующих субъектов	6	0	2	0	31	10	
5	Управление рисками	6	0	2	0	31	10	
6	Методы анализа и показатели оценки риска	6	0	2	0	31	10	
		Итого:	6	8	0	184	54	

\* 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.

#### *Очно-заочная форма обучения*

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 5
Аудиторные занятия (АЗ):	36	36
Лекционные занятия (Лек)	18	18
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	18	18
Самостоятельная работа студента (СР)	146	146
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	146	146
Контроль самостоятельной работы (КСР)	7	7
Контактная работа (КоР)	43	43
Форма промежуточной аттестации	0	Экзамен
Подготовка к экзамену и сдача экзамена (СР, КоР)	27	27
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	216/6	216/6

\* 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	Понятие риска в экономике	5	4	4	0	24	8
2	Место и роль риск-менеджмента в экономике предприятия	5	4	4	0	24	8
3	Организация моделирования рисков проекта.	5	4	4	0	24	8
4	Система операционных риск-индикаторов хозяйствующих субъектов	5	2	2	0	24	10
5	Управление рисками	5	2	2	0	25	10
6	Методы анализа и показатели оценки риска	5	2	2	0	25	10
Итого:			18	18	0	146	54

\* 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 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>

3. УПРАВЛЕНИЕ ФИНАНСОВЫМИ РИСКАМИ 2-е изд., испр. и доп. Учебник и практикум для вузов / Под ред. Хоминич И.П. - Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова (г. Москва), 2022 г. - 569 с. - ISBN 978-5-534-13380-6 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-finansovymi-riskami-489981>

*Дополнительная литература:*

1. КОРПОРАТИВНАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ: СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ И КОМПЛАЕНС В КОМПАНИИ. Учебное пособие для вузов / Панарина М. М. - Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики» (г. Москва), 2022 г. - 158 с. - ISBN 978-5-534-15342-2 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/korporativnaya-bezopasnost-sistema-upravleniya-riskami-i-komplaens-v-kompanii-497632>

2. 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>

3. ОСНОВЫ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА / Кроуи М., Гэлаи Д., Минасян В. Б., Марк Р. - Российская академия народного хозяйства и государственной службы при Президенте РФ (г. Москва), 2022 г. - 390 с. - ISBN 978-5-534-02578-1 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/osnovy-risk-menedzhmenta-488656>

**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

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

1. [ibooks.ru](http://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: [arch.neicon.ru](http://arch.neicon.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. Экономический портал [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <http://institutiones.com>. - Текст: электронный

9. Цифровая экономика [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <https://data-economy.ru/2024>. - Текст: электронный

10. Молодежный Союз Экономистов и Финансистов [Электронный ресурс] : информационная справочная система. - Режим доступа: <http://www.msef.ru>. - Текст: электронный

11. Министерство экономического развития Российской Федерации: профессиональная база данных. - Режим доступа: <http://economy.gov.ru>. - Текст: электронный

12. Министерство финансов Российской Федерации: профессиональная база данных. -

Режим доступа: <https://minfin.gov.ru/ru>. - Текст: электронный

13. Экономика. Социология. Менеджмент: федеральный образовательный портал: профессиональная база данных. - Режим доступа: <http://ecsocman.hse.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. 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

3. 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

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

#### «Против рекламы».

Рекламное агентство «Омега» получила заказ на проведение кампании по анонсированию продукта — электрического чайника новой модели. Дата запуска продукта назначена на 18 июня. Для всех работ по осуществлению запуска и проведению рекламной кампании имеется ровно 2 месяца.

По предварительному сценарному плану рекламная кампания будет опираться на три основных канала коммуникаций:

- наружная реклама — 100 баннеров 3x6 на в течение четырех недель;
- реклама на тв — трансляция промо-ролика на 15 секунд в течение двух недель;
- инсайд реклама — размещение рекламных плакатов в партнерских торговых сетях в течение трех недель.

После итогового совещания с клиентом и подписанием контракта часть проектной группы рекламного агентства выразило протест относительно предложенных каналов маркетинговой коммуникации. Среди возражавших явно выделилось две группы оппозиции.

Первые были против канала наружной рекламы, объясняя это тем, что большинство подрядчиков по монтажу баннеров совершенно не соблюдали сроки и никак не гарантировали размещение всех 100 баннеров за три недели до 18го числа.

Вторые были против инсайд рекламы, так как, по их мнению, сотрудники партнерских сетей очень халатно относятся к размещению данных носителей и не являются подконтрольными рекламному агентству. Это, в свою очередь, может полностью нивелировать желаемый эффект и поставит под угрозу репутацию рекламного агентства.

Стоит отметить, что общий бюджет рекламной кампании делится между каналами коммуникации следующим образом: наружная реклама – 35%, реклама на тв – 45%, инсайд реклама – 20%. В таких же пропорциях рекламное агентство «Омега» несет ответственность перед заказчиком.

#### Задачи:

1. Объясните точку зрения каждой из групп оппозиции.
2. Сформулируйте основные риски, которые могут быть связаны с проведением данной рекламной кампании.
3. Что бы вы предложили руководителю данного проекта по проведению рекламной кампании?

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

### **«Срочная доставка».**

Макс работает частным курьером по срочной доставке очень ценных и малогабаритных грузов. У него отличная репутация и очень высокая стоимость услуг. Длительный опыт раллийных гонок и новенький Subaru Impreza позволяют ему чрезвычайно быстро выполнять заказы. Многие крупные бизнесмены и политики пользуются его услугами, доверяя ему доставку ценных бумаг, документов и подарков.

Максу получает очень дорогостоящий заказ — необходимо доставить пакет с документами из Питера в Москву. Время получения пакета курьером 8 мая после 21:00. Время получения пакета получателем с 10:00 до 11:00 следующего дня. Заказчик сообщил, что в случае нарушения сроков доставки более чем на 5 минут или утраты пакета, курьера ждут серьезные неприятности. Также было озвучено, что содержимое пакета может представлять весомую ценность для непосвященных людей.

Макс часто работает по маршруту Москва-Питер, и кратчайшее время в пути у него составляет 4 часа. Но сейчас автомобиль Макса находится в ремонте, и ему взамен предлагают Ford Focus, вызывающий сомнения в своем техническом состоянии.

### **Задачи:**

1. Оцените возможные риски, связанные с потенциальным заказом.
2. Какие рекомендации вы можете дать Максиму в данной ситуации?
3. Оцените предлагаемые рекомендации с точки зрения понятий восприятия риска и толерантности к риску.

## **Доклад, сообщение/Реферат №1**

1. Риск и его место в повседневной жизни.
2. Основные параметры риска.
3. Характерные особенности риска.
4. Концепция риска.
5. Двойственная природа риска.
6. Основные функции риска.
7. Классификация рисков.
8. Риск и философия экстремальных видов спорта.
9. Управление рисками в проектной деятельности.
10. Управление рисками в операционной деятельности.
11. Система управления рисками на предприятии.
12. Управление рисками в производственном процессе.
13. Управление финансовыми и инвестиционными рисками.
14. Сферы человеческой деятельности с высоким уровнем риска.
15. Концепция приемлемого риска.
16. Графические методы оценки риска.
17. Математические методы оценки риска.
18. Понимание уровня риска.
19. Матрица риска. Сочетание вероятности и воздействия.
20. Воздействие риска на качество проекта.

21. Особенности метода «Дерево решений».
22. Дерево отказов (fault tree analysis).
23. Диаграмма Исикавы как метод идентификации рисков.
24. Понимание среды риска.
25. Оценка срочности риска.
26. Сущность качественного анализа риска.
27. Сущность количественного анализа риска.
28. Особенности метода EMV (Expected Monetary Value).
29. Уклонение от риска как метод реагирования.
30. Особенности распределения риска как метода реагирования.
31. Сущность смягчения риска как метода реагирования.
32. Принятие риска.
33. Использование возможностей как метод реагирования на риски.
34. Разделение возможностей как метод реагирования на риски.
35. Усиление возможностей как метод реагирования на риски.
36. Принятие возможностей как метод реагирования на риски.

### Собеседование, опрос/Контрольная работа №1

Планирование реагирования на риски.

В таблице ниже представлены виды реагирования на риски и рисковые события. Сформулируйте действия, которые будут соответствовать виду реагирования и установленному для него рисковому событию.

Вид реагирования	Рисковое событие	Действия
Уклонение от риска	«Застревание» в автомобильной пробке	
Передача риска	Задержка доставки необходимых материалов	
Смягчение риска	Возгорание в квартире	
Использование возможностей	Повышение курса валюты	
Распределение возможностей	Появление тенденции к оранжевому цвету в упаковке схожих товаров	
Усиление возможностей	Появление новой технологии в отрасли	

### Коллоквиум/Проект (групповой проект) №1

Содержание задания:

1. Составить описания проекта, которое должно в себя включать цель проекта и дополнительную значимую информацию об условиях реализации проекта.
2. Провести идентификацию рисков проекта, результатом которой будет являться сформированный список рисковых событий (количество событий не менее 50).
3. Проведение качественного анализа рисков: установление шкалы оценки рисков, создание матрицы рисков, ранжирование рисковых событий с учетом значений матрицы. Дополнительную оценку провести по критерию срочности возникновения риска.
4. Предложить перечень мероприятий по управлению риском для каждого рискового события с высоким и умеренным уровнем риска. Полученные в ходе текущего этапа данные рекомендуется оформить в таблицу:

Рисковое событие	Вид реагирования на риск	Мероприятия по управлению риском

### **Коллоквиум/Проект (групповой проект) №2**

1. Организация молодежного музыкального фестиваля.
2. Запуск нового продукта народного потребления.
3. Открытие банковского филиала.
4. Проведение рекламной кампании бытовой техники.
5. Организация выставки автомобильных концептов.
6. Разработка новостного интернет-портала.
7. Съемка коммерческого фильма.
8. Проведение соревнований по спортивной гимнастике среди юниоров.
9. Разработка компьютерной видеоигры.
10. Создания программного обеспечения для складского учета запасов.
11. Внедрение системы электронного документооборота в производственную компанию.
12. Создание фирменного стиля новой торговой марки электронных девайсов.
13. Проведение социологического исследования для городской администрации.

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

Не предусмотрено учебным планом

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

#### **Примерный перечень теоретических вопросов к экзамену ( Вопрос № 1)**

1. В чем заключается сущность предпринимательского риска?
2. Каковы основные факторы, влияющие на степень рискованности предпринимательского дела?
3. Как взаимосвязаны понятия «риск» и «неопределенность»?
4. В чем проявляется риск создания дополнительной прибыли?
5. Каковы важнейшие факторы рисков в современных условиях?
6. В чем специфика рисков в России?
7. Что понимают под риском инновационной деятельности?
8. В чем суть концепции приемлемого риска применительно к инновационной деятельности?
9. Каковы основные факторы инновационного предпринимательства?
10. В чем отличие инновационного проекта от инвестиционного?
11. С чем связаны риски практической реализации инновационных проектов?
12. Каковы факторы риска финансирования инновационных проектов?
13. Каковы важнейшие факторы, влияющие на риск несоответствия научно-технического потенциала компании.
14. Что такое управление риском?
15. Как развивалась программа управления рисками?
16. Каковы основные принципы управления рисками?
17. Как управление риском связано с общим менеджментом фирмы?
18. В чем сущность процедуры «планирование управления рисками»?
19. В чем сущность процедуры «идентификация рисков»?

20. В чем сущность процедуры «количественная оценка рисков»?
21. В чем сущность процедуры «качественная оценка рисков»?
22. В чем сущность процедуры «планирование управления рисками»?
23. В чем сущность процедуры «мониторинг и контроль рисков»?
24. Перечислите и охарактеризуйте цели системы управления рисками.
25. В чем состоит содержание идентификации рисков?
26. Какие этапы можно выделить в процессе идентификации рисков?
27. Какие факторы относят к внешним факторам риска?

### **Примерный перечень теоретических вопросов к экзамену ( Вопрос № 2)**

1. Какие факторы относят к внутренним факторам риска?
2. Приведите схему процесса распознавания факторов риска.
3. Основные направления в качестве возможных целей классификации рисков.
4. В чем состоит классификация по источнику рисков?
5. В чем состоит классификация по управляемости рисков?
6. В чем состоит классификация по приемлемости рисков?
7. В чем состоит классификация по времени возникновения рисков?
8. В чем состоит классификация по продолжительности воздействия рисков?
9. В чем состоит классификация по степени детерминированности?
10. В чем состоит классификация по традиционности-специфичности?
11. В чем состоит классификация по ретроспективности?
12. На каких принципиальных положениях основан метод качественной оценки показателей рисков?
13. Приведите классификацию методов качественного анализа.
14. Опишите достоинства и недостатки метода экспертных опросов.
15. В чем суть SWOT-анализа?
16. Охарактеризуйте методы «роза рисков» и «спираль рисков».
17. Опишите экспертный подход к оценке риска
18. В чем суть метода Дельфи?
19. В чем суть рейтинг-метода?
20. Опишите историко-ассоциативные методы анализа риска.
21. Опишите метод литературно-фантастических аналогий.
22. Охарактеризуйте метод «концептуальные переносы».
23. На чем основан количественный подход к анализу риска?
24. В чем состоит задача количественного анализа?
25. Основные группы методов количественного анализа.
26. Охарактеризуйте метод анализа чувствительности проекта.
27. Опишите основной прием анализа чувствительности – анализ точки безубыточности.
28. Опишите общие подходы к анализу чувствительности

### **Примерный перечень практических заданий к экзамену ( Вопрос № 3)**

#### **Практическое задание (вариант 1) Представление информации по сценариям.**

В таблице ниже укажите возможные величины для представленных событий. Объясните каждую из указанных величин.

Событие	Оптимистичный сценарий	Вероятный сценарий	Пессимистичный сценарий
---------	------------------------	--------------------	-------------------------

Падение смартфона стоимостью 24 т. руб. с высоты 1м			
Взлом квартиры			
Срыв сроков проекта, стоимостью 540 т. руб.			
Выход из строя оборудования основного производства			

### Практическое задание (вариант 2) Планирование реагирования на риски.

В таблице ниже представлены виды реагирования на риски и рисковые события. Сформулируйте действия, которые будут соответствовать виду реагирования и установленному для него рисковому событию.

Вид реагирования	Рисковое событие	Действия
Уклонение от риска	«Застревание» в автомобильной пробке	
Передача риска	Задержка доставки необходимых материалов	
Смягчение риска	Возгорание в квартире	
Использование возможностей	Повышение курса валюты	
Распределение возможностей	Появление тенденции к оранжевому цвету в упаковке схожих товаров	
Усиление возможностей	Появление новой технологии в отрасли	

Раздел билета	Компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине	Количество баллов
Вопрос №1 Теоретический вопрос (проверяет знания («знать»), сформированные дисциплиной)	ПК-2 ПК-3	Знать основные методы финансового менеджмента для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала. Знать систему показателей, характеризующих эффективность управленческих решений в сфере инвестиционных решений.	30
Вопрос №2 Теоретический вопрос (проверяет знания («знать»), сформированные дисциплиной)	ПК-2 ПК-3	Знать основные методы финансового менеджмента для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала. Знать систему показателей, характеризующих эффективность управленческих решений в сфере инвестиционных решений.	30

38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль) "Проектный менеджмент"

Рабочая программа дисциплины

Дисциплина: Б1.В.09 Риск-менеджмент

Форма обучения: очная, заочная, очно-заочная

Разработана для приема 2023/2024 учебного года

Раздел билета	Компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине	Количество баллов
Вопрос №3 Практическое задание (проверяет умения («уметь»), проверяет практические навыки («владеть»), сформированные дисциплиной)	ПК-2 ПК-3	Уметь применять навыки самостоятельной работы при изучении учебной литературы в сфере финансового менеджмента для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала. Владеть навыками самостоятельной работы при изучении учебной литературы, необходимой для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала. Уметь использовать теоретические данные, связанные с основными показателями деятельности фирмы, необходимыми для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала. Владеть способностью самостоятельно осваивать прикладные экономические знания, необходимые для принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала.	40