

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.ДВ.03.02 Управление рисками
Направление подготовки:	38.04.02 Менеджмент
Направленность (профиль):	Стратегический менеджмент
Уровень высшего образования:	Магистратура
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:*

изучение основных понятий, а также получение базовых умений в области управления рисками.

Задачи дисциплины:

· Дать обучающимся основные понятия и термины управления рисками. · Научить оценивать риски и определять способы их снижения. · Выявление причин возникновения каждого вида рисков. · Освоение стратегических и тактических приемов управления различными видами рисков, а также возможности их сочетания.

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 Способен участвовать в разработке, внедрении и совершенствовании инвестиционного проекта с применением современных технологий и интеллектуальных методов в экономике и бизнесе	ПК-3.1 Знает методы и модели управления инвестиционными проектами, системный анализ, теорию принятия решений при реализации инвестиционного проекта.	08.036 Профессиональный стандарт «Специалист по работе с инвестиционными проектами»
	ПК-3.2 Умеет работать в специализированных компьютерных программах для подготовки инвестиционного проекта.	
	ПК-3.3 Способен определять состав участников и управлять командой инвестиционного проекта.	

Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-3.1. Знает методы и модели управления инвестиционными проектами, системный анализ, теорию принятия решений при реализации инвестиционного проекта.	Знать критерии выбора эффективных управленческих решений, в том числе с учетом уровня рисков
ПК-3.2. Умеет работать в специализированных компьютерных программах для подготовки инвестиционного проекта.	Уметь работать с финансовыми документами, в том числе с бухгалтерской отчетностью, использовать ее в аналитических целях и диагностировать с ее помощью финансовые риски деятельности предприятия
ПК-3.3. Способен определять состав участников и управлять командой инвестиционного проекта.	Владеть навыками выбора и применения инструментальных средств для обработки экономических данных

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-3.2	ПК-3.3
1	Основные понятия теории управления рисками.	ПК-3	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №1 (10)	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №1 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
2	Система рисков организации.	ПК-3	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №1 (10)	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №1 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Компетенции	Оценочные средства текущего контроля		
			ЗНАТЬ	УМЕТЬ	ВЛАДЕТЬ
			ПК-3.1	ПК-3.2	ПК-3.3
3	Роль риска в менеджменте организации.	ПК-3	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №2 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
4	Принципы и методы управления рисками.	ПК-3	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №2 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
5	Разработка и реализация программы управления рисками.	ПК-3	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №3 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
Количество баллов (100 баллов):			100		

Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа	
<p>Тема 1: Основные понятия теории управления рисками. Объект управления рисками как научной дисциплины, цели и задачи. Актуальные направления развития управления рисками. Связь управления рисками с другими областями знания. Подходы к определению понятия «риск» в экономике и в менеджменте. Событие риска, последствия риска. Риск как следствие внешнего воздействия на организацию Практические занятия/самостоятельная работа: Содержание характеристик понятия «риск». Лабораторная работа: -</p>	
<p>Тема 2: Система рисков организации. Факторы и источники риска в управлении. Классификация факторов риска: фоновые, косвенного воздействия, прямого воздействия, внутриорганизационные факторы риска. Взаимосвязь факторов риска. Динамика факторов риска как показатель кризисного состояния процессов. Управленческое решение, как объект управления рисками. Управление рисками на индивидуальном уровне. Управление рисками на организационном уровне. Принципы и признаки классификации рисков. Структурные и процессные риски в управлении. Использование классификации рисков в разработке управленческих решений. Практические занятия/самостоятельная работа: Комплексный подход к оценке риска. Лабораторная работа: -</p>	
<p>Тема 3: Роль риска в менеджменте организации. Роль неопределенности в формировании риска. Объективная природа неопределенности в управлении организацией. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска. Взаимосвязь и закономерности формирования неопределенности и риска при разработке управленческих решений. Цели управления рисками. Существенные признаки рисков и их влияние на эффективность управления: частота реализации, масштаб последствий от реализации, однородность рисков. Управление рисками и регулирование рисков Практические занятия/самостоятельная работа: Оценка эффективности способов управления рисками. Лабораторная работа: -</p>	
<p>Тема 4: Принципы и методы управления рисками. Принципы управления рисками. Содержание основных видов деятельности по управлению рисками: ретроспективная, текущая, перспективная. Стратегические, тактические и операционные риски, взаимосвязь планирования рисков и планирования развития организации. Характеристика методов управления рисками: метод избежания рисков, метод принятия рисков на себя, метод предотвращения убытков, метод уменьшения размера убытков, страхование, самострахование, методы передачи рисков. Принципы использования и комбинирования методов управления рисками. Подходы к оценке рисков. Математическое описание рисков. Методы анализа рисков Практические занятия/самостоятельная работа: Функции и механизм управления финансовыми рисками. Лабораторная работа: -</p>	

38.04.02 Менеджмент, направленность (профиль) "Стратегический менеджмент"

Рабочая программа дисциплины

Дисциплина: Б1.В.ДВ.03.02 Управление рисками

Форма обучения: очная, заочная, очно-заочная

Разработана для приема 2023/2024 учебного года

Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа
<p>Тема 5: Разработка и реализация программы управления рисками. Общая логика разработки и реализации программы: уточнение стратегии организации по управлению рисками и выбор процедур; предварительный отбор рисков; отбор предупредительных мероприятий и формирование их плана; анализ рисков после формирования плана предупредительных мероприятий; контроль и пересмотр программы управления рисками; оценка эффективности программы управления рисками</p> <p>Практические занятия/самостоятельная работа: Процесс управления рисками предприятия.</p> <p>Лабораторная работа: -</p> <p>Курсовая работа: не предусмотрено учебным планом</p>

Очная форма обучения

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 4
Аудиторные занятия (АЗ):	28	28
Лекционные занятия (Лек)	14	14
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	14	14
Самостоятельная работа студента (СР)	40	40
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	40	40
Контроль самостоятельной работы (КСР)	4	4
Контактная работа (КоР)	32	32
Форма промежуточной аттестации	0	Экзамен
Подготовка к экзамену и сдача экзамена (СР, КоР)	36	36
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	108/3	108/3

* 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	Основные понятия теории управления рисками.	4	2	2	0	6	2
2	Система рисков организации.	4	2	4	0	8	4
3	Роль риска в менеджменте организации.	4	4	2	0	8	2
4	Принципы и методы управления рисками.	4	2	4	0	8	4
5	Разработка и реализация программы управления рисками.	4	4	2	0	10	2
Итого:			14	14	0	40	14

* 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 5
Аудиторные занятия (АЗ):	10	10
Лекционные занятия (Лек)	4	4
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	6	6
Самостоятельная работа студента (СР)	85	85
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	85	85
Контроль самостоятельной работы (КСР)	4	4
Контактная работа (КоР)	14	14
Форма промежуточной аттестации	0	Экзамен
Подготовка к экзамену/зачету и сдача экзамена/зачета (СР, КоР)	9	9
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	108/3	108/3

* 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	Основные понятия теории управления рисками.	5	2	2	0	17	2
2	Система рисков организации.	5	0	0	0	17	4
3	Роль риска в менеджменте организации.	5	0	2	0	17	2
4	Принципы и методы управления рисками.	5	2	0	0	17	4
5	Разработка и реализация программы управления рисками.	5	0	2	0	17	2
Итого:			4	6	0	85	14

* 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):	20	20
Лекционные занятия (Лек)	8	8
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	12	12
Самостоятельная работа студента (СР)	49	49
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	49	49
Контроль самостоятельной работы (КСР)	3	3
Контактная работа (КоР)	23	23
Форма промежуточной аттестации	0	Экзамен
Подготовка к экзамену и сдача экзамена (СР, КоР)	36	36
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	108/3	108/3

* 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	Основные понятия теории управления рисками.	5	2	2	0	10	2
2	Система рисков организации.	5	2	2	0	10	4
3	Роль риска в менеджменте организации.	5	0	2	0	10	2
4	Принципы и методы управления рисками.	5	2	4	0	10	4
5	Разработка и реализация программы управления рисками.	5	2	2	0	9	2
Итого:			8	12	0	49	14

* 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. 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>

2. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ, СИСТЕМНЫЙ АНАЛИЗ И МОДЕЛИРОВАНИЕ В 3 Ч. ЧАСТЬ 1. Учебник и практикум для вузов / Белов П. Г. - Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет) (г. Москва), 2022 г. - 211 с. - ISBN 978-5-534-02606-1 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-riskami-sistemnyy-analiz-i-modelirovanie-v-3-ch-chast-1-490634>

3. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ, СИСТЕМНЫЙ АНАЛИЗ И МОДЕЛИРОВАНИЕ В 3 Ч. ЧАСТЬ 2. Учебник и практикум для вузов / Белов П. Г. - Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет) (г. Москва), 2022 г. - 250 с. - ISBN 978-5-534-02608-5 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-riskami-sistemnyy-analiz-i-modelirovanie-v-3-ch-chast-2-490635>

4. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ, СИСТЕМНЫЙ АНАЛИЗ И МОДЕЛИРОВАНИЕ В 3 Ч. ЧАСТЬ 3. Учебник и практикум для вузов / Белов П. Г. - Московский авиационный институт (национальный исследовательский университет) (г. Москва), 2022 г. - 272 с. - ISBN 978-5-534-02609-2 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-riskami-sistemnyy-analiz-i-modelirovanie-v-3-ch-chast-3-490636>

Дополнительная литература:

1. 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>

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. 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>

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 : 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. - 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. Управление производством [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <http://www.up-rpo.ru>. - Текст: электронный

9. Корпоративный менеджмент [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <https://www.cfin.ru>. - Текст: электронный

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

11. 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, 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, веб-камерой, микрофоном и гарнитурой (в т.ч. интегрированными в устройства). Авторизация на информационно-образовательном portalе Университета 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

Коллоквиум/Проект (групповой проект) №1

1. По каким признакам принято классифицировать риски?
2. Назовите классификацию рисков.
3. Какая цель идентификации опасности и риска и какие этапы процесса их идентификации?
4. В чем заключается понятие и суть оценки риска?
5. На каких уровнях и с какой целью производится оценка риска?
6. Назовите основные элементы системы управления рисками.
7. Что является методологическим базисом проектирования системы управления рисками?

Коллоквиум/Проект (групповой проект) №2

1. Какие действия предпринимаются с целью снижения риска?
2. Какие предупреждающие меры могут привести к снижению уровня риска?
3. Сформулируйте основные задачи стратегического управления рисками?
4. Сформулируйте системы оперативного управления рисками?
5. На основе чего определяется оценка экономической эффективности системы управления рисками?
6. Какие методы управления рисками Вы знаете?
7. Как оценивается степень негативного влияния на репутацию и имидж предприятия в глазах общественности?

Собеседование, опрос/Контрольная работа №1

Вопросы для обсуждения: 1. Принципы управления рисками 2. Основные этапы управления

рисками 3. Выбор методов управления рисками 4. Выбор стратегии по отношению к рискам 5. Способы снижения рисков. Российская и международная практика. 6. Роль страхования в системе риск-менеджмента. 7. Страхование и хеджирование.

Вопросы для обсуждения: 1. Риски в предпринимательской деятельности 2. Классификация рисков отдельных видов деятельности 3. Специфика рисков отдельных видов деятельности 4. Предпринимательские риски 5. Пути трансформации понятия «риск».

Ситуационная задача №1. Студент должен выбрать любое экономическое явление или экономический процесс, которые сопровождаются появлением рисков. Явлением может быть, например, период подъема в экономике; поставка скоропортящихся товаров – мясной продукции; выдача кредита фермеру, выращивающему кукурузу; снижение дефицита бюджета; проведение образовательных курсов; реализация хлебобулочных изделий; производство спиртных напитков (водка, вино) и другое... Анализ выбранного явления и управление рисками должно быть расценено как инвестиционный проект или управленческие мероприятия. Все, что относится к экономической деятельности оценивается в денежной форме, поэтому, после выбора явления необходимо оценить стоимость данного явления – объем капитала, необходимого для успешной реализации проекта. Далее, после выбора явления и его оценки от студента требуется представить минимум 8 факторов, вызывающих риск по данному явлению

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

Ситуационная задача №1. Вложения на мировых валютных рынках. Стоимость вложений 50 000 рублей. Факторы: Изменение курсов валют, не задействованных в сделках, и цен с других сегментов финансовых рынков; Изменение экономических показателей; Намерения центрального банка осуществить интервенцию; Квалификация аналитика; Квалификация менеджера отдела; Заинтересованность аналитика в максимизации прибыли от сделок; Выработка торговой стратегии; Выбор квалифицированного и качественного брокера; Выбор банка обслуживающего счет; Качество связи с брокером. Следующее, необходимо выбрать и объяснить принадлежность факторов к классификации риска, определить тип инвестирования, тип капитальных вложений области риска, назначить сумму, необходимую для управления риском по каждому фактору. Эти суммы не должны превышать сумму проекта в целом. Необходимо помнить, что из это суммы следует осуществить сам проект. Далее, следует указать вид неопределенности, с которым связан каждый фактор. Далее, следует указать общий принцип управления риском по каждому фактору.

Дискуссия по проблемным вопросам. 1. Проанализируйте, какие виды потерь могут возникнуть в организации в результате воздействия риска. 3. Обоснуйте, при какой ситуации вероятность негативного воздействия риска максимальна. 4. Обоснуйте значимость деятельности риск-менеджера. Дискуссия на тему: сущность и значимость риск-менеджмента в управлении современной организацией. Групповое обсуждение вопросов: причины отсутствия единого понимания сущности риска; причины, из-за которых предпринимательство ассоциируется с риском; вклад представителей классической и неоклассической теории предпринимательского риска; объекты управления в системе риск- менеджмента; формы управляющего воздействия в управлении риском; виды рисков; функции риск-менеджмента. На основании проведенной дискуссии и обсуждения делается вывод о значимости системы риск-менеджмента для эффективного управления организацией. Оценка участия в дискуссии. В целях закрепления практического материала и углубления теоретических знаний по разделам дисциплины «Управление рисками» предполагается проведение дискуссий по темам предложенным преподавателем.

Коллоквиум/Проект (групповой проект) №3

Вариант 1

1. Основные определения и понятия риск-менеджмента.

2. Процессы управления риском.
3. Категории «риск» и «доходность».
4. Основные элементы и этапы управления риском.
5. Манипулирование риском.

Вариант 2

1. Идентификация и концептуальные направления анализа рисков.
2. Качественный анализ.
3. Количественная оценка.
4. Этапы идентификации и анализа рисков.
5. Принципы информационного обеспечения системы управления риском.
6. Полезность информации.
7. Эффективность управления риском.
8. Доступность информации.
9. Достоверность информации.
10. Общие группы источников информации при анализе конкретных рисков.
11. Информационная система, обслуживающая процесс управления рисками.
12. Визуализация рисков. Приемы визуализации рисков.

Доклад, сообщение/Реферат №1

1. Сущность риска и неопределенности, социально-экономические последствия реализации различных рисков
2. Объекты и факторы риска, их влияние на эффективность проектов.
3. Классификации рисков.
4. Основные стратегии и методы управления эффективностью проектов с учетом рисков.
5. Основные стандарты по управлению рисками.
6. Расчет риска на основе методологии VaR.
7. Расчет риска на основе ожидаемой полезности.
8. Показатели эффективности с учетом риска.
9. Статистические методы оценки и прогнозирования рисков.
10. Анализ чувствительности проектов.
11. Методы выявления рисков.
12. Диагностика рисков.
13. Идентификация рисков.
14. Картографирование рисков.
15. Условия и факторы выбора метода прогнозирования рисков.
16. Стратегически ориентированная система риск-менеджмента.
17. Внедрение системы риск-менеджмента.
18. Отчетность в системе риск-менеджмента.
19. Методы прогнозирования рыночных рисков.
20. Хеджирование как метод управления рыночными рисками.
21. Риски процентных ставок.
22. Показатели операционной деятельности, их роль в прогнозировании результатов проектов.
23. Методы прогнозирования и управления операционными рисками.
24. Сущность прогнозирования рисков инновационной деятельности.
25. Методы прогнозирования и управления рисками в сфере внедрения инноваций.
26. Особенности прогнозирования и управления рисками в государственных и муниципальных организациях

9.2. Примерный перечень тем курсовой работы

9.3. Типовые контрольные задания для промежуточной аттестации: экзамен

Примерный перечень теоретических вопросов к экзамену (Вопрос № 1)

1. Характеристика теорий предпринимательского риска (классической, неоклассической, кейнсианской).
2. Понятие и характеристики риска.
3. Функции риска.
4. Специфика операционных рисков.
5. Критерии и виды классификации рисков.
6. Сущность классификации рисков в зависимости от времени возникновения.
7. Виды рисков в зависимости от основной причины возникновения.
8. Виды финансовых рисков. 9. Общие черты и проявления инфляционного риска.
10. Типы операционных рисков и их особенности.
11. Распределение обязанностей в системе управления операционными рисками.
12. Охарактеризуйте виды рисков, связанных со снижением доходности.
13. Основные виды имущественных рисков.
14. Виды и причины потерь в предпринимательстве.
15. Основные инструменты управления операционными рисками.
16. Границы и зоны хозяйственного риска.
17. Основные задачи управления рисками.
18. Решение задач управления риском на разных этапах жизненного цикла организации.
19. Объекты и субъекты управления рисками.
20. Системный подход в управлении рисками: сущность, характерные черты.
21. Классификация методов управления рисками.
22. Варианты стратегии предпринимателя, связанные с принятием решения в условиях неопределенности.
23. Охарактеризуйте критерии принятия управленческих решений в условиях неопределенности и риска.
24. Критерии риска защищенности страны.
25. Основные направления государственной стратегии снижения рисков.
26. Особенности управления рисками в банковской сфере.
27. Принципы управления экологическими рисками.
28. Законодательные и нормативные требования по управлению рисками.

Примерный перечень практических заданий к экзамену (Вопрос № 2)

Задание 1. Подготовка и защита презентации на следующие темы: 1. Обоснуйте значимость организационной структуры системы риск-менеджмента и ее встраивания в существующую организационную структуру предприятия. 2. Проведите сравнение роли и решаемых задач риск-менеджеров и владельцев рисков в деятельности организации. 3. Проведите сравнение методов выявления операционных рисков и условий их применения: анкетирование; проведение интервью; мозговой штурм; потоковые диаграммы; графические карты; инспекции; анализ отчетности и документации.

Раздел билета	Компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине	Количество баллов
Вопрос №1 Теоретический вопрос (проверяет знания («знать»), сформированные дисциплиной)	ПК-3	Знать критерии выбора эффективных управленческих решений, в том числе с учетом уровня рисков	40

38.04.02 Менеджмент, направленность (профиль) "Стратегический менеджмент"

Рабочая программа дисциплины

Дисциплина: Б1.В.ДВ.03.02 Управление рисками

Форма обучения: очная, заочная, очно-заочная

Разработана для приема 2023/2024 учебного года

Раздел билета	Компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине	Количество баллов
Вопрос №2 Практическое задание (проверяет умения («уметь»), проверяет практические навыки («владеть»), сфор-мированные дисциплиной)	ПК-3	Уметь работать с финансовыми документами, в том числе с бухгалтерской отчетностью, использовать ее в аналитических целях и диагностировать с ее помощью финансовые риски деятельности предприятия Владеть навыками выбора и применения инструментальных средств для обработки экономических данных	60