

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:	ФТД.02 Управление рисками
Направление подготовки:	38.04.04 Государственное и муниципальное управление
Направленность (профиль):	Государственное регулирование экономики
Уровень высшего образования:	Магистратура
Форма обучения:	очная, заочная, очно-заочная
Разработчики:	Кандидат экономических наук, доцент Ключев 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. выявить причины возникновения каждого вида рисков. освоить стратегические и тактические приемы 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-1 Способен осуществлять регулирование в сфере разработки государственных программ, проектов и документов стратегического планирования	ПК-1.1 Знает основные направления бюджетной политики на текущий год и плановый период; основные направления и приоритеты государственной политики в области долгосрочной бюджетной политики.	П.25.3. Вид профессиональной служебной деятельности: Регулирование в сфере разработки государственных программ, проектов и документов стратегического планирования (Справочник квалификационных требований)
	ПК-1.2 Уметь проводить анализ и прогноз экономической ситуации в отдельных странах, региональных объединениях и в мировой экономике в целом.	
	ПК-1.3 Способен осуществлять регулирование государственных программ, проектов и документов стратегического планирования.	
ПК-2 Способен осуществлять регулирование в сфере государственных инвестиций и инвестиционной деятельности	ПК-2.1 Знает методику оценки коммерческой привлекательности инвестиционного проекта; основные положения и критерии заключения инвестиционного соглашения между частным инвестором и органом государственной власти; основные формы и виды оказания государственной поддержки российским и зарубежным организациям в реализации инвестиционных проектов.	П.25.13. Вид профессиональной служебной деятельности: Регулирование в сфере государственных инвестиций и инвестиционной деятельности (Справочник квалификационных требований)
	ПК-2.2 Умеет проводить подготовку предложений по совершенствованию нормативно-правового регулирования инвестиционной деятельности и привлечения иностранных инвестиций.	
	ПК-2.3 Способен формировать аналитические справки о состоянии инвестиционной деятельности в Российской Федерации; осуществлять взаимодействие с иностранными инвесторами по различным сферам деятельности Минэкономразвития России; координировать сопровождение инвестиционной деятельности.	

Планируемые результаты освоения ОП ВО (код и содержание компетенций)	Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Примечание
ПК-3 Способен осуществлять и развивать государственную поддержку бизнеса и предпринимательства	ПК-3.1 Знает основные формы и виды государственной поддержки субъектов малого и среднего предпринимательства; специальные режимы налогообложения малых и средних предприятий; основные формы отчетности о хозяйственной деятельности юридических лиц и индивидуальных предпринимателей и особенности работы с ними	П.25.9. Вид профессиональной служебной деятельности: Развитие и осуществление государственной поддержки бизнеса и предпринимательства (Справочник квалификационных требований)
	ПК-3.2 Умеет проводить анализ финансовой отчетности по федеральным средствам, предоставляемым субъектами Российской Федерации в рамках реализации мероприятий по программе государственной поддержки малого и среднего предпринимательства и контроль за целевым использованием средств.	
	ПК-3.3 Способен участвовать в подготовке ежегодного доклада о состоянии и развитии малого и среднего предпринимательства в Российской Федерации и мерах по его развитию, используя автоматизированную информационную систему АИС «Управление государственной поддержкой малого и среднего предпринимательства».	

Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-1.1. Знает основные направления бюджетной политики на текущий год и плановый период; основные направления и приоритеты государственной политики в области долгосрочной бюджетной политики.	Знать основные понятия и термины управления рисками
ПК-1.2. Уметь проводить анализ и прогноз экономической ситуации в отдельных странах, региональных объединениях и в мировой экономике в целом.	Уметь обобщать, анализировать, воспринимать информацию, ставить цели и выбирать путей их достижения
ПК-1.3. Способен осуществлять регулирование государственных программ, проектов и документов стратегического планирования.	Владеть основными методами, способами и средствами получения, хранения, переработки информации, использовать компьютер как средство работы с информацией
ПК-2.1. Знает методику оценки коммерческой привлекательности инвестиционного проекта; основные положения и критерии заключения инвестиционного соглашения между частным инвестором и органом государственной власти; основные формы и виды оказания государственной поддержки российским и зарубежным организациям в реализации инвестиционных проектов.	Знать особенности и механизм управления рисками в различных областях и сферах предпринимательской деятельности
ПК-2.2. Умеет проводить подготовку предложений по совершенствованию нормативно-правового регулирования инвестиционной деятельности и привлечения иностранных инвестиций.	Уметь осуществлять выбор управленческих решений на основе критериев социально-экономической эффективности, рис-ков и возможных социально-экономических последствий.

Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-2.3. Способен формировать аналитические справки о состоянии инвестиционной деятельности в Российской Федерации; осуществлять взаимодействие с иностранными инвесторами по различным сферам деятельности Минэкономразвития России; координировать сопровождение инвестиционной деятельности.	Владеть навыками критической оценки вариантов управленческих решений; расчета критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий
ПК-3.1. Знает основные формы и виды государственной поддержки субъектов малого и среднего предпринимательства; специальные режимы налогообложения малых и средних предприятий; основные формы отчетности о хозяйственной деятельности юридических лиц и индивидуальных предпринимателей и особенности работы с ними	Знать критерии выбора эффективных управленческих решений, в том числе с учетом уровня рисков.
ПК-3.2. Умеет проводить анализ финансовой отчетности по федеральным средствам, предоставляемым субъектами Российской Федерации в рамках реализации мероприятий по программе государственной поддержки малого и среднего предпринимательства и контроль за целевым использованием средств.	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 участвовать в подготовке ежегодного доклада о состоянии и развитии малого и среднего предпринимательства в Российской Федерации и мерах по его развитию, используя автоматизированную информационную систему АИС «Управление государственной поддержкой малого и среднего предпринимательства».	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-1.1 ПК-2.1 ПК-3.1	ПК-1.2 ПК-2.2 ПК-3.2	ПК-1.3 ПК-2.3 ПК-3.3
1	Основные понятия теории управления рисками.	ПК-1 ПК-2 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-1 ПК-2 ПК-3	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №1 (10)	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №1 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
3	Тема 3. Роль риска в менеджменте организации.	ПК-1 ПК-2 ПК-3	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №2 (10)	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №1 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №2 (20)
4	Тема 4. Принципы и методы управления рисками .	ПК-1 ПК-2 ПК-3	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №2 (10)	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №1 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №3 (20)

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Компетенции	Оценочные средства текущего контроля		
			ЗНАТЬ	УМЕТЬ	ВЛАДЕТЬ
			ПК-1.1 ПК-2.1 ПК-3.1	ПК-1.2 ПК-2.2 ПК-3.2	ПК-1.3 ПК-2.3 ПК-3.3
5	Тема 5. Разработка и реализация программы управления рисками.	ПК-1 ПК-2 ПК-3	Собеседование, опрос/ Контрольная работа №2 (10)	Коллоквиум/ Проект (групповой проект) №1 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №3 (20)
<b>Количество баллов (100 баллов):</b>			100		

<b>Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа</b>	
<p><b>Тема 1:</b> 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.</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Содержание характеристик понятия «риск».</p> <p><b>Лабораторная работа:</b> -</p>	
<p><b>Тема 2:</b> Система рисков организации. 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.</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Комплексный подход к оценке риска.</p> <p><b>Лабораторная работа:</b> -</p>	
<p><b>Тема 3.</b> 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</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Оценка эффективности способов управления рисками.</p> <p><b>Лабораторная работа:</b> -</p>	
<p><b>Тема 4.</b> 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.</p> <p><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Функции и механизм управления финансовыми рисками.</p> <p><b>Лабораторная работа:</b> -</p>	
<p><b>Тема 5.</b> 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><b>Практические занятия/самостоятельная работа:</b> Процесс управления рисками предприятия.</p> <p><b>Лабораторная работа:</b> -</p>	

**Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа****Курсовая работа:**

не предусмотрено учебным планом

*Очная форма обучения*

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 2
Аудиторные занятия (АЗ):	32	32
Лекционные занятия (Лек)	16	16
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	16	16
Самостоятельная работа студента (СР)	36	36
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	36	36
Контроль самостоятельной работы (КСР)	4	4
Контактная работа (КоР)	36	36
Форма промежуточной аттестации	0	Зачет
Подготовка к экзамену и сдача экзамена (СР, КоР)	0	0
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	72/2	72/2

\* 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	Основные понятия теории управления рисками.	2	2	2	0	8	2	
2	Система рисков организации.	2	4	4	0	8	4	
3	Тема 3. Роль риска в менеджменте организации.	2	4	4	0	8	4	
4	Тема 4. Принципы и методы управления рисками .	2	2	2	0	8	2	
5	Тема 5. Разработка и реализация программы управления рисками.	2	4	4	0	4	4	
Итого:			16	16	0	36	16	

\* 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 4
Аудиторные занятия (АЗ):	8	8
Лекционные занятия (Лек)	4	4
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	4	4
Самостоятельная работа студента (СР)	57	57
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	57	57
Контроль самостоятельной работы (КСР)	3	3
Контактная работа (КоР)	11	11
Форма промежуточной аттестации	0	Зачет
Подготовка к экзамену/зачету и сдача экзамена/зачета (СР, КоР)	4	4
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	72/2	72/2

\* 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	Основные понятия теории управления рисками.	4	2	0	0	10	2	
2	Система рисков организации.	4	0	0	0	12	4	

№	Наименование темы дисциплины	Семестр/ Курс	Количество учебных часов				Практическая подготовка
			В том числе по видам аудиторных занятий			СР	
			Лек	Пр	Лаб		
3	Тема 3. Роль риска в менеджменте организации.	4	0	0	0	11	4
4	Тема 4. Принципы и методы управления рисками .	4	0	2	0	12	2
5	Тема 5. Разработка и реализация программы управления рисками.	4	2	2	0	12	4
Итого:			4	4	0	57	16

\* 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 2
Аудиторные занятия (АЗ):	32	32
Лекционные занятия (Лек)	16	16
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	16	16
Самостоятельная работа студента (СР)	38	38
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	38	38
Контроль самостоятельной работы (КСР)	2	2
Контактная работа (КоР)	34	34
Форма промежуточной аттестации	0	Зачет
Подготовка к экзамену и сдача экзамена (СР, КоР)	0	0
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	72/2	72/2

\* 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.	2	2	2	0	6	2
2	Система рисков организации.	2	4	4	0	6	4
3	Тема 3. Роль риска в менеджменте организации.	2	4	4	0	8	4
4	Тема 4. Принципы и методы управления рисками .	2	2	2	0	8	2
5	Тема 5. Разработка и реализация программы управления рисками.	2	4	4	0	10	4
Итого:			16	16	0	38	16

\* 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-sistemnyu-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-sistemnyu-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-sistemnyu-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 : 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. 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. HR-tv.ru [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <https://thehrd.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. Executive.ru: профессиональная база данных . - Режим доступа: <https://www.executive.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

##### Коллоквиум/Проект №1

1. Каково место финансовых рисков в системе финансового менеджмента предприятия? 2. В чем отличие финансовых рисков от других видов риска? 3. Каковы сущность и виды финансовых рисков? 4. Каковы принципы управления финансовыми рисками? 5. Что является информационным обеспечением системы управления рисками? 6. Каковы объекты и субъекты финансовых рисков? 7. В чем заключаются методы качественной оценки риска? 8. В чем заключаются методы количественной оценки риска? 9. Что означает визуализация риска? 10. Какие существуют методы управления рисками? 11. Как связаны понятия «риск» и «доходность»? 12. Как оценивается риск отдельного финансового актива? 13. В чем суть альфа- и бета-коэффициентов? 14. Какие статистические показатели меры риска существуют? 15. В чем суть модели оценки финансовых активов CAPM? 16. Как оценивается риск инвестиционного портфеля? 17. Как оценивается доходность инвестиционного портфеля? 18. Что такое операционный рычаг и как он связан с финансовым рычагом? 19. Что такое финансовый рычаг и как он связан с финансовым риском? 20. Какие составляющие участвуют в расчете эффекта финансового рычага? 21. Каковы методы управления финансовым рычагом и финансовым риском? 22. Какие существуют производные финансовые инструменты? 23. Что такое форвардный контракт? 24. В чем отличие фьючерсного контракта от форвардного? 25. Что такое опционный контракт? 26. В чем сходства и отличия фьючерсных и опционных контрактов? 27. Что такое своп? 28. В чем суть спекуляции на рынке производных финансовых инструментов? 29. Что такое хеджирование финансовых рисков? 30. Как производные ценные бумаги используются для хеджирования финансовых рисков?

---

### **Собеседование, опрос/Контрольная работа №1**

1. Характеристика основных теорий финансовых рисков. 2. Важность изучения проблем финансовых рисков и их оценка. 3. Условия принятия решений при анализе финансового риска; способы оценки степени риска; кривая риска. 4. Критерии количественной оценки финансового риска. 5. Сущность финансового риска. 6. Функции финансового риска. 7. Место финансового риска в общей классификации рисков. 8. Классификация финансовых рисков по видам способам проявления. 9. Современные классификации финансовых рисков и их основные проявления. 10. Характеристика составляющих системы риска, управление рисками, страхование рисков. 11. Принципы управления финансовыми рисками. 12. Система управления рисками. 13. Реализация политики управления финансовыми рисками. 14. Принципы информационного обеспечения системы управления риском. 15. Внешние и внутренние источники информации. 16. Визуализация рисков. 17. Методы трансформации рисков. 18. Методы финансирования рисков. 19. Способы снижения степени риска. 20. Средства разрешения финансовых рисков. 21. Приемы снижения степени риска. 22. Экономическое содержание и классификация инвестиционных рисков. 23. Субъекты инвестиционного риска. 24. Соотношение доходности и риска

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

В настоящее время в России все больше внимания уделяется развитию профессионального и творческого потенциала работников, формированию предпринимательской этики, поддержанию высокой ответственности за качество обслуживания клиентов, выпускаемой продукции, за работу и судьбу организации в целом. Службы управления человеческими ресурсами руководствуются следующими принципами: • подчеркивать уважение к индивидуальности и ценности каждого человека путем поощрения высокой производительности труда; • поддерживать доверительные отношения и уважение работников друг к другу; • нести ответственность за обучение и повышение профессионализма персонала; поощрять инициативу каждого, одновременно поддерживать свободную творческую деятельность; • стимулировать принятие на себя ответственности работниками в сложных ситуациях; • предоставлять каждому работнику возможность для реализации его индивидуальных способностей; • лучше расставлять кадры; • повышать ответственность за развитие трудового потенциала персонала; • обеспечивать справедливую оплату труда; 12 • оценивать результаты работы по достижению поставленных целей.

Вопросы: 1. Какие еще принципы управления персоналом могли бы сыграть серьезную роль? 2. Какие риски обозначены в кейсе и соответствуют ли упомянутые в кейсе принципы особенностям русского менталитета, специфике, историческим чертам русского человека?

### **Собеседование, опрос/Контрольная работа №2**

1. Перечислите основные характеристики рисковой ситуации. 2. Дайте ситуативное и математическое определение риска, а также определение риска по Дж. М. Кейнсу. 3. Какие виды неопределенности можно выделить? 4. Как понимается риск в узком и широком смыслах? 5. Как влияет структура финансов экономического субъекта на его подверженность финансовым рискам? 6. Каковы причины возникновения финансовых рисков? 7. Что представляет собой система рисков личных финансов и какие существуют способы управления данными рисками? 8. В чем состоит влияние финансового риска на другие виды предпринимательского риска? 9. Перечислите макроэкономические факторы финансовых рисков. 10. Какие существуют инструменты воздействия на финансовые риски со стороны государства?

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

Персонал организации систематически не укладывается в устанавливаемые руководителем плановые сроки выполнения заданий. Что должен предпринять руководитель? Какие риски существуют для организации. Выявите явные и не явные риски для организации.

### **Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №3**

#### **Вариант 1**

Вас назначают руководителем государственного учреждения социального обслуживания, в

---

котором специалисты не привыкли работать в полную силу, предоставлены самим себе, в штывки воспринимают любые попытки изменить характер их работы. Что вы как руководитель будете делать?

Задание: определите многообразие необходимых управленческих шагов, предпринимаемых менеджером, и кратко обоснуйте их последовательность. Какие риски могут быть обозначены для организации. Определите степень вероятности рискованных событий для организации и причины их возникновения?

### **Вариант 2**

Российская производственная компания, имеющая несколько региональных заводов, запустила программу по формированию управленческого резерва на производстве. На предприятиях были организованы ассесмент-центры, лучшие кандидаты отобраны и зачислены в резерв.

Прошло полгода. За это время с заводов уволилось 4% резервистов. Причины своего увольнения они объяснили следующим образом:

- после зачисления в резерв непосредственный руководитель начал активнее загружать работой, ставить более сложные задачи, за невыполнение наказывать;
- от начальника нет поддержки и советов, помощь практически не оказывается;
- дважды шеф не отпускал на тренинги по развитию менеджерских навыков, проводимых кадровой службой.

Все эти факты серьезно озаботили департамент управления персоналом.

**Задание к кейсу:** Как снизить риск негативного влияния непосредственных руководителей на развитие резервистов и наиболее продуктивное использование их потенциала?

## **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. Риск: сущность риска, событие риска, последствия риска.
2. Условия риска как объективные условия деятельности и развития организации.
3. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
4. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.
5. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.
6. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска.
7. Существенные признаки рисков. Влияние риска на эффективность управления.
8. Управление рисками и регулирование рисков.
9. Организация как объект управления рисками.
10. Классификация факторов риска по степени непосредственного воздействия на эффективность управления.
11. Структурные и процессуальные факторы риска: проблемы идентификации и оценки.
12. Использование теории жизненного цикла организации при анализе и планировании рисков.
13. Подходы к управлению рисками: интенсивный, экстенсивный.
14. Классификация рисков в управлении: признаки классификации, принципы использования.
15. Взаимосвязь структурных и процессных рисков в управлении организацией.
16. Аксиоматика управления рисками.
17. Виды деятельности по управлению рисками.
18. Взаимосвязь планирования в управлении рисками и планирования развития организации.
19. Метод избежания рисков.
20. Метод принятия рисков на себя.

21. Метод предотвращения убытков.
22. Метод уменьшения размера убытков.
23. Метод страхования.
24. Метод самострахования.
25. Метод передачи рисков.
26. Принципы использования и комбинирования методов управления рисками.
27. Методологические принципы оценки рисков.
28. Количественные методы оценки рисков.
29. Качественные методы оценки рисков.
30. Использование моделирования в управлении рисками.
31. Уточнение стратегии организации при разработке программы управления рисками.
32. Предварительный отбор рисков при разработке программы управления рисками.
33. Разработка плана превентивных мероприятий программы управления рисками.
34. Анализ рисков как этап разработки программы управления рисками.
35. Контроль и пересмотр программы управления рисками.
36. Оценка эффективности программы управления рисками.
37. Особенности управления рисками в финансовой и инвестиционной сферах деятельности организации.
38. Риск в управлении прямыми и портфельными инвестициями.
39. Распределение рисков между участниками проекта.
40. Классификация рисков производственной деятельности.
41. Области применения статистических методов при анализе рисков.
42. Сущность статистических методов анализа рисков.
43. Оценка степени риска по совокупности статистических критериев.
44. Области применения анализа безубыточности в риск-менеджменте.
45. Сущность анализа безубыточности в оценке рисков.
46. Оценка степени риска предпринимательского проекта.
47. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределенности и риска минимаксными методами

**Примерный перечень практических заданий к зачету:**

Задача 1. Инвестору за 5 лет необходимо накопить капитал для реализации инвестиционного проекта в сумме 2,5 млн. рублей, определить периодически депонируемый поток платежей (ежемесячно) от дохода, по ставке 14% годовых.

Задача 2. Рассчитать будущую стоимость потока арендных платежей, возникающих в конце года, если годовой арендный платеж первые четыре года составляет 400 тыс. руб., затем он уменьшится на 150 тыс. руб. и сохранится в течение трех лет. Ставка дисконта — 12%.

Задача 3. Сбербанк выдал кредит на сумму 2 млн руб. сроком на 10 лет под 12% годовых.

Погашение кредита должно производиться равными ежемесячными выплатами в конце каждого года, включающими погашение основного долга и процентные платежи.

Задача 4. Достаточно ли положить на счет 600 тыс. рублей на депозитный счет с ежемесячным начислением сложных процентов по ставке 10% годовых для приобретения через 5 лет дома стоимостью 900 тыс. руб.