

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:

ФИО: Ашмарина Светлана Владимировна

Должность: Ректор ФГБОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 01.02.2021 09:46:10

Уникальный программный ключ:

59650034d6e3a6baac49b7bd0f8e79fea1433ff3e82f1fc7e9279a031181baba

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации**  
**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение**  
**высшего образования**  
**«Самарский государственный экономический университет»**

**Институт менеджмента**

**Кафедра Прикладного менеджмента**

**УТВЕРЖДЕНО**

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 29 апреля 2020 г.)

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

**Наименование дисциплины**

Б1.В.02 Менеджмент риска

**Основная профессиональная образовательная программа**

Направление 38.03.02 МЕНЕДЖМЕНТ программа "Финансовый менеджмент"

Методический отдел УМУ

« 04 » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

*Ашмарина* / *Светлана Владимировна*

Научная библиотека СГЭУ

« 20 » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

*Ашмарина* / *Светлана Владимировна*

Рассмотрено к утверждению

на заседании кафедры Прикладного менеджмента  
(протокол № 7 от 18.03.2020г.)

Зав. кафедрой \_\_\_\_\_ /С.И. Ашмарина/

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

## Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

## 1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Менеджмент риска входит в вариативную часть блока Б1.Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Управление материальными ресурсами, Стратегический менеджмент

Последующие дисциплины по связям компетенций: Управление конкурентоспособностью, Консультационный проект, Финансовый консалтинг, Ценообразование, Поведенческая экономика, Ключевые показатели эффективности, Управление собственностью, Финансовые основы предпринимательской деятельности, Инвестиционный анализ, Антикризисное управление, Управление финансовой безопасностью, Экономическая безопасность

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Менеджмент риска в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

### Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-9 - способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-9	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК9з1: специфику макроэкономического воздействия на предприятия, организации различных отраслей, а также органов государственного и муниципального управления	ПК9у1: анализировать состояние макроэкономической среды, динамику её изменения, выявлять ключевые элементы, рыночные и специфические риски	ПК9в1: навыками принятия рациональных управленческих решений на уровне органов государственного регулирования; методами анализа рыночных и специфических рисков с целью использования его результатов при принятии управленческих решений
	ПК9з2: экономические основы поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли, методы их оценки и прогнозирования	ПК9у2: оценивать влияние факторов макросреды на организации в системе менеджмента государственного и муниципального управления; анализировать поведение потребителей экономических благ, факторы формирования потребительского спроса	ПК9в2: навыками анализа субъектов рынка, конъюнктуры рынка, потребительской удовлетворенности, поведения потребителей экономических благ с учетом влияния динамических процессов на их структуру

ПК-15 - умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-15	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК15з1: принципы организации финансового планирования и прогнозирования ; понятие и классификация рыночных и специфических рисков	ПК15у1: разрабатывать и выполнять планы и программы финансового планирования; измерять и оценивать уровень и опасность наступления рыночных и специфических рисков	ПК15в1: технологиями финансового планирования и прогнозирования, навыками инвестиционного проектирования
	ПК15з2: методы учета инвестиционных рисков и технологии управления ими; базовые понятия и принципы, используемые при анализе эффективности инвестиций	ПК15у2: интерпретировать результаты определения ключевых показателей эффективности инвестирования в целях принятия оптимальных финансовых и инвестиционных решений; на основе оценки инвестиционных возможностей формировать оптимальный инвестиционный портфель	ПК15в2: методами оценки эффективности инвестиционных решений, применения критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий

ПК-3 - владением навыками стратегического анализа, разработки и осуществления стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-3	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	: методы и основные теории стратегического менеджмента; содержание и взаимосвязь основных элементов процесса стратегического управления	: разрабатывать корпоративные, конкурентные и функциональные стратегии развития организации	ПК3в1: методами формулирования и реализации стратегий на уровне бизнес-единицы
	: подходы к анализу систем качества продукции, услуг – с целью обеспечения её конкурентоспособности	: проводить анализ конкурентной сферы отрасли для повышения конкурентоспособности организации	ПК3в2: методами анализа отраслевых рынков в целях повышения конкурентоспособности организаций – участников этих рынков

### 3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

#### Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 5
Контактная работа, в том числе:	56.4/1.57
Занятия лекционного типа	18/0.5
Занятия семинарского типа	36/1
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.4/0.01
Групповая контактная работа (ГКР)	2/0.06
Самостоятельная работа, в том числе:	69.6/1.93
Промежуточная аттестация	18/0.5
Вид промежуточной аттестации:	
Экзамен	Экз
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	144
Зачетные единицы	4

#### заочная форма

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 5
Контактная работа, в том числе:	18.4/0.51
Занятия лекционного типа	8/0.22
Занятия семинарского типа	8/0.22
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.4/0.01
Групповая контактная работа (ГКР)	2/0.06
Самостоятельная работа, в том числе:	118.6/3.29
Промежуточная аттестация	7/0.19
Вид промежуточной аттестации:	
Экзамен	Экз
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	144
Зачетные единицы	4

### 4. Содержание дисциплины

#### 4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Менеджмент риска представлен в таблице.

#### Разделы, темы дисциплины и виды занятий

##### Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа		ИКР		
			Практич. занятия	ГКР			
1.	Понятие риска и его функции	4	8			34,8	ПК9з1, ПК9з2, ПК9у1, ПК9у2, ПК9в1, ПК9в2, ПК15з1, ПК15з2, ПК15у1, ПК15у2, ПК15в1, ПК15в2, , ,

							, , ПК3в1, ПК3в2	
2.	Основные положения менеджмента риска	14	28			34,8	ПК9з1, ПК9з2, ПК9у1, ПК9у2, ПК9в1, ПК9в2, ПК15з1, ПК15з2, ПК15у1, ПК15у2, ПК15в1, ПК15в2, , , , , ПК3в1, ПК3в2	
	Контроль	18						
	<b>Итого</b>	<b>18</b>	<b>36</b>	<b>0.4</b>	<b>2</b>	<b>69.6</b>		

#### заочная форма

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе	
		Лекции	Занятия семинарского типа		ИКР			ГКР
			Практич. занятия					
1.	Понятие риска и его функции	2	2			59	ПК9з1, ПК9з2, ПК9у1, ПК9у2, ПК9в1, ПК9в2, ПК15з1, ПК15з2, ПК15у1, ПК15у2, ПК15в1, ПК15в2, , , , , ПК3в1, ПК3в2	
2.	Основные положения менеджмента риска	6	6			59,6	ПК9з1, ПК9з2, ПК9у1, ПК9у2, ПК9в1, ПК9в2, ПК15з1, ПК15з2, ПК15у1, ПК15у2, ПК15в1, ПК15в2, , , , , ПК3в1, ПК3в2	
	Контроль	7						
	<b>Итого</b>	<b>8</b>	<b>8</b>	<b>0.4</b>	<b>2</b>	<b>118.6</b>		

#### 4.2 Содержание разделов и тем

##### 4.2.1 Контактная работа

###### Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Понятие риска и его функции	лекция	Понятие риска и его функции
		лекция	Классификация и виды рисков
2.	Основные положения менеджмента риска	лекция	Основные положения менеджмента риска
		лекция	Содержание идентификации и качественного анализа рисков
		лекция	Основы количественного анализа рисков
		лекция	Концепция приемлемого риска

		лекция	Методы и инструменты управления рисками
		лекция	Мониторинг и корректировка системы управления рисками
		лекция	Принятие управленческих решений в условиях риска и неопределенности

\*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

#### Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Понятие риска и его функции	практическое занятие	Понятие риска и его функции
		практическое занятие	Классификация и виды рисков
2.	Основные положения менеджмента риска	практическое занятие	Основные положения менеджмента риска
		практическое занятие	Содержание идентификации и качественного анализа рисков
		практическое занятие	Основы количественного анализа рисков
		практическое занятие	Концепция приемлемого риска
		практическое занятие	Методы и инструменты управления рисками
		практическое занятие	Мониторинг и корректировка системы управления рисками
		практическое занятие	Принятие управленческих решений в условиях риска и неопределенности

\*\* семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

#### Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

#### 4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Понятие риска и его функции	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Основные положения менеджмента	- подготовка доклада

	риска	- подготовка электронной презентации - тестирование
--	-------	--------------------------------------------------------

\*\*\* самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

## 5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

### 5.1 Литература:

#### Основная литература

Основы риск-менеджмента / Д. Гэлаи, М. Кроуи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 390 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02578-1. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/431722>

Абчук, В. А. Менеджмент в 2 ч. Часть 1 : учебник и практикум для академического бакалавриата / В. А. Абчук, С. Ю. Трапицын, В. В. Тимченко. — 3-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 239 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01757-1. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/433734>

Абчук, В. А. Менеджмент в 2 ч. Часть 2 : учебник и практикум для академического бакалавриата / В. А. Абчук, С. Ю. Трапицын, В. В. Тимченко. — 3-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 249 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02141-7. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/437196>

#### Дополнительная литература

Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 365 с. — (Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/432176>

Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич, И. В. Пещанской. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 345 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01019-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/433674>

Вагин С. Г. Менеджмент [Электронный ресурс] : учебное пособие / Е. А. Малышева, К. С. Николаева, Ю. С. Шарикова. - Самара : СГЭУ, 2015. - 356 с. - ISBN 978-5-94622-589-2. <http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

#### Учебники и монографии:

1. Балдин, К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К.В. Балдин, И.И. Передеряев, Р.С. Голов. — М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2012. — 420 с.

2. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч.: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — М. : Издательство Юрайт, 2016. — 211 с.

3. Васин, С.М. Управление рисками на предприятии [Текст] : учебное пособие / С.М. Васин, В.С. Шутов. — М.: КНОРУС, 2010. — 304 с.

4. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — М. : Издательство Юрайт, 2016. — 353 с. — (Авторский учебник).

5. Грачева, М.В. Управление рисками в инновационной деятельности [Текст] : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / М.В. Грачева, С.Ю. Ляпина. — М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2010. — 351 с.

6. Екатеринославский, Ю. Ю. Риски бизнеса. Диагностика, профилактика, управление / Ю.Ю. Екатеринославский, А.М. Медведева, С.А. Щенкова. — М.: Анкил, 2010.

7. Качалов, Р.М. Управление экономическим риском: теоретические основы и приложения [Текст]: монография. — СПб., 2012.

8. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для академического бакалавриата / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. - 2-е изд., перераб. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2016. — 381 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс).

9. Основы риск-менеджмента / Д. Гэлаи, М. Кроуи, Р. Марк. — М. : Издательство Юрайт, 2016. — 390 с. — (Бакалавр. Академический курс).

10. Пименов, Н. А. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности : учебник и практикум / Н. А. Пименов ; под общ. ред. В. И. Авдийского. — М. :



Издательство Юрайт, 2016. — 413 с.

11. Серебрякова, Т.Ю. Риски организации и внутренний экономический контроль : монография. – М.: ИНФРА-М, 2010. – 111с.

12. Стребел, Пол Грамотные ходы. Как умные стратегия, психология управление рисками обеспечивают успех бизнеса / Пол Стребел, Энн-Валери Оллсон [Пер. с англ. А. Столярова]. – М.: ЗАО «Олимп-Бизнес», 2013. – 208 с.

13. Тихонов, Е.П. Риски в управлении предприятием: виды, анализ, оценка, пути и методы снижения / Е.П. Тихонов. – М.: Лаборатория книги, 2011.

14. Управление корпоративными рисками : инструменты хеджирования: учебное пособие / Уколов А. И., Гупалова Т. Н. – М.: Директ-Медиа, 2014.

15. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. П. Архипов [и др.]. — М. : Издательство Юрайт, 2016. — 345 с.

16. Черняк, В.З. Управление предпринимательскими рисками в системе экономической безопасности. Теоретический аспект [Текст] : монография / В.З. Черняк, Н.Д. Эриашвили, Е.Н. Барикаев. – М.: ЮНИТИ-ДАНА; Закон и право, 2015. - 159 с.

17. Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций / А.С, Шапкин, В.А. Шапкин. - М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2012. – 544 с.

#### **Статьи в журналах:**

1. Боброва, Н.М. Планирование управления рисками как ключевой элемент системы управления рисками [Текст] / Н.М. Боброва // Экономика и предпринимательство. 2014. № 11-3 (52-3). С. 808-811.

2. Глазкова, И.Н. Принципы формирования системы риск-менеджмента и контуры модели управления предпринимательскими рисками [Текст] / И.Н. Глазкова, Н.Ф. Газизуллин // Проблемы современной экономики. 2014. № 3 (51). С. 159-161.

3. Кононов, В.Н. Вопросы становления риск-менеджмента в качестве самостоятельной науки [Текст] / В.Н. Кононов, Н.В. Аталиа // Экономика и политика. - 2013. - № 6 (6). - С. 46-50.

4. Макарова, М.А. Формирование системы риск-менеджмента на предприятии [Текст] / М.А. Макарова // Вестник Псковского государственного университета. Серия: Экономика. Право. Управление. 2014. № 4. С. 98-108.

5. Псарева, Н.Ю. Методология формирования системы риск-менеджмента компании [Текст] / Н.Ю. Псарева // Труд и социальные отношения. - 2014. - № 1. - С. 81-87.

6. Ромашкина, О.В. Риск-аппетит и толерантность к риску: определение и управление [Текст] / О.В. Ромашкина // Вестник Университета (Государственный университет управления). 2012. № 3. С. 248-250.

7. Рудаков, Д.В. Проблемы риск-менеджмента предприятий в России [Текст] / Д.В. Рудаков, М.Е. Михайлова // Динамика систем, механизмов и машин. - 2012. - № 4. - С. 37-39.

8. Севернюк, Э.Б. Риск-менеджмент в новой системе координат [Текст] / Э.Б. Севернюк // Проблемы анализа риска. - 2014. - Т. 11. - № 2. - С. 88-90.

9. Ситникова, Я.В. Концептуальный подход к управлению рисками субъектов хозяйственной деятельности в современных условиях развития [Текст] / Я.В. Ситникова // Вестник НГУЭУ. 2012. Т. 2. № 4. С. 154-161.

10. Харитонов, Д.А. Направления построения эффективного риск-менеджмента промышленного предприятия [Текст] / Д.А. Харитонов // Ярославский педагогический вестник. 2013. Т. 1. № 3. С. 93-97.

11. Шитова, А.М. Налоговые риски в системе риск-менеджмента [Текст] / А.М. Шитова // Новая наука: Проблемы и перспективы. 2016. № 6-1 (85). С. 278-284.

#### **5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения**

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Office 365 ProPlus, Microsoft Office 2019, Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)

### 5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

### 5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

### 5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

Для проведения занятий лекционного типа используются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в виде презентационных материалов, обеспечивающих тематические иллюстрации.

## 6. Фонд оценочных средств по дисциплине Менеджмент риска:

### 6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	-
	Устный/письменный опрос	+
	Тестирование	+
	Практические задачи	-
	Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения)	-
Промежуточный контроль	Экзамен	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования, утвержденными Ученым советом ФГБОУ ВО СГЭУ №10 от 29.04.2020

### 6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

#### Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-9 - способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК9з1: специфику макроэкономического воздействия на предприятия, организации различных отраслей, а также органов государственного и муниципального управления	ПК9у1: анализировать состояние макроэкономической среды, динамику её изменения, выявлять ключевые элементы, рыночные и специфические риски	ПК9в1: навыками принятия рациональных управленческих решений на уровне органов государственного регулирования; методами анализа рыночных и специфических рисков с целью использования его результатов при принятии управленческих решений
Повышенный	ПК9з2: экономические основы поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли, методы их оценки и прогнозирования	ПК9у2: оценивать влияние факторов макросреды на организации в системе менеджмента государственного и муниципального управления; анализировать поведение потребителей экономических благ, факторы формирования	ПК9в2: навыками анализа субъектов рынка, конъюнктуры рынка, потребительской удовлетворенности, поведения потребителей экономических благ с учетом влияния динамических процессов на их структуру

потребительского спроса

ПК-15 - умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК15з1: принципы организации финансового планирования и прогнозирования ; понятие и классификация рыночных и специфических рисков	ПК15у1: разрабатывать и выполнять планы и программы финансового планирования; измерять и оценивать уровень и опасность наступления рыночных и специфических рисков	ПК15в1: технологиями финансового планирования и прогнозирования, навыками инвестиционного проектирования
Повышенный	ПК15з2: методы учета инвестиционных рисков и технологии управления ими; базовые понятия и принципы, используемые при анализе эффективности инвестиций	ПК15у2: интерпретировать результаты определения ключевых показателей эффективности инвестирования в целях принятия оптимальных финансовых и инвестиционных решений; на основе оценки инвестиционных возможностей формировать оптимальный инвестиционный портфель	ПК15в2: методами оценки эффективности инвестиционных решений, применения критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий

ПК-3 - владением навыками стратегического анализа, разработки и осуществления стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	: методы и основные теории стратегического менеджмента; содержание и взаимосвязь основных элементов процесса стратегического управления	: разрабатывать корпоративные, конкурентные и функциональные стратегии развития организации	ПК3в1: методами формулирования и реализации стратегий на уровне бизнес-единицы
Повышенный	: подходы к анализу систем качества продукции, услуг – с целью обеспечения её конкурентоспособности	: проводить анализ конкурентной сферы отрасли для повышения конкурентоспособности организации	ПК3в2: методами анализа отраслевых рынков в целях повышения конкурентоспособности организаций – участников этих рынков

### 6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Понятие риска и его функции	ПК9з1, ПК9з2, ПК9у1, ПК9у2, ПК9в1, ПК9в2, ПК15з1, ПК15з2, ПК15у1, ПК15у2, ПК15в1, ПК15в2, ПК3в1, ПК3в2	Устный/письменный опрос Тестирование	Экзамен
2.	Основные положения менеджмента риска	ПК9з1, ПК9з2, ПК9у1, ПК9у2, ПК9в1, ПК9в2, ПК15з1, ПК15з2, ПК15у1, ПК15у2, ПК15в1, ПК15в2, ПК3в1, ПК3в2	Устный/письменный опрос Тестирование	Экзамен

### 6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

#### Вопросы для устного/письменного опроса

Раздел дисциплины	Вопросы
Понятие риска и его функции	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Основные теории риска: классическая теория, неоклассическая теория, кейнсианская теория.</li> <li>2. Риск как экономическая категория.</li> <li>3. Основные подходы к определению риска: риск как вероятность (угроза) потерь, риск как опасность негативных последствий, риск как деятельность, действие, риск как неопределенность, риск как событие.</li> <li>4. Основные атрибуты риска как экономической категории: состояние неопределенности, необходимость выбора из множества альтернатив (включая отказ от выбора), возможность отклонения от предполагаемой цели, вероятностная оценка отклонения.</li> <li>5. Объективно-субъективная природа риска.</li> <li>6. Понятие неопределенности.</li> <li>7. Виды неопределенности (природная, связанная с обработкой информации, поведенческая).</li> <li>8. Формы неопределенности (неизвестность, недостаточность информации, недостоверность информации, непредсказуемость).</li> <li>9. Основные функции риска (регулятивная, защитная, инновационная и др.).</li> <li>10. Критерии классификации по типу объекта.</li> <li>11. Критерии классификации по причине (природе) ущерба.</li> <li>12. Критерии классификации по типичности отрицательных последствий.</li> <li>13. Критерии классификации по степени учета временного фактора.</li> <li>14. Критерии классификации по степени распространенности.</li> <li>15. Критерии классификации по вероятности (частоте)</li> </ol>

	<p>возникновения.</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>16. Критерии классификации по размеру ущерба.</li> <li>17. Критерии классификации по характеристике расходов (издержек), связанных с риском.</li> <li>18. Специфические классификации рисков (банковские риски, страховые риски и др.).</li> <li>19. Понятие менеджмента риска.</li> <li>20. Стандарты риск-менеджмента (ISO 31000:2009, FERMA, COSO ERM).</li> <li>21. Основные свойства управления рисками (системный характер управления рисками, сложная структура системы управления рисками, высокая результативность системы управления рисками).</li> <li>22. Старая и новая парадигмы менеджмента риска.</li> <li>23. Характеристики системы управления рисками на разных стадиях развития организации.</li> <li>24. Управление рисками как часть общего менеджмента фирмы.</li> <li>25. Аксиомы, законы и функции риск-менеджмента.</li> <li>26. Основные правила менеджмента риска.</li> <li>27. Система риск-менеджмента: процесс и организационная структура.</li> <li>28. Основные этапы процесса управления рисками: установление внутреннего и внешнего контекста, идентификация рисков, оценка рисков, мероприятия по управлению рисками, мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском.</li> <li>29. Взаимосвязи между этапами процесса управления рисками.</li> <li>30. Организационная структура менеджмента риска (без создания специального отдела, создание специального подразделения по управлению рисками, аутсорсинг менеджмента риска).</li> <li>31. Основные функции отдела риск-менеджмента.</li> <li>32. Место отдела риск-менеджмента в общей структуре организации при различных типах организационных структур (функциональная, дивизиональная, адаптивная).</li> <li>33. Управление рисками и стратегия развития фирмы.</li> <li>34. Понятие риск-аппетита и способы его определения.</li> <li>35. Риск-культура организации и ее содержание.</li> <li>36. Система менеджмента риска в соответствии со стандартом COSO ERM: взаимосвязь системы внутреннего контроля с целями и уровнями организации.</li> <li>37. Национальный стандарт РФ ГОСТ Р ИСО 31000-2010 «Менеджмент риска. Принципы и руководство».</li> <li>38. Понятие идентификации и качественного анализа рисков.</li> <li>39. Этапы идентификации и качественного анализа рисков.</li> <li>40. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.</li> </ol>
<p>Основные положения менеджмента риска</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Принципы информационного обеспечения системы управления риском.</li> <li>2. Внешние и внутренние источники информации.</li> <li>3. Источники информации для идентификации риска.</li> <li>4. Информационная система, обслуживающая процесс управления риском.</li> <li>5. Основные методы идентификации рисков.</li> <li>6. Реестр рисков и его содержание.</li> </ol>

7. Понятие количественного анализа рисков.
8. Методы количественного анализа рисков (статистические методы, аналитические методы, методы экономико-математического моделирования, методы экспертных оценок).
9. Статистические методы оценки рисков: методы оценки вероятности рискового события (метод построения деревьев событий, метод деревьев отказов, метод деревьев решений), методы оценки размеров возможного ущерба, методы оценки важности рисков (математическое ожидание, среднее ожидаемое значение, колеблемость (изменчивость) возможного результата).
10. Аналитические методы оценки рисков: анализ чувствительности, анализ сценариев, анализ точки безубыточности, анализ финансовой устойчивости).
11. Методы экономико-математического моделирования (линейное программирование, корреляционно-регрессионный анализ, математическая теория игр и др.).
12. Методы экспертных оценок.
13. Основные этапы экспертного анализа рисков.
14. Требования к формированию экспертной группы.
15. Методика экспертного анализа рисков.
16. Понятие концепции приемлемого риска.
17. Предельно допустимый уровень риска.
18. Карта (матрица) рисков.
19. Преимущества построения карты рисков.
20. Уровни рассмотрения и принятия решений о рисках.
21. Способы установления приемлемого уровня риска в организации.
22. Основные этапы обработки рисков (планирование, практическая подготовка, активация).
23. Методы управления рисками в зависимости от характера воздействия: методы уклонения, методы снижения, методы передачи, методы сохранения).
24. Методы управления рисками в зависимости от изменения характеристик риска (регулирование риска, финансирование риска). Методы управления рисками по содержанию (экономические, организационно-технические, социально-психологические).
25. Методы уклонения от риска: особенности применения, недостатки.
26. Методы снижения рисков (предупреждение рисков, уменьшение последствий рисков): сегрегация, комбинация и дублирование активов, диверсификация бизнеса, лимитирование, проверка контрагентов и др.
27. Методы передачи рисков: страхование, распределение, хеджирование.
28. Преимущества и недостатки применения каждого метода.
29. Сохранение (удержание) рисков.
30. Осознанное и неосознанное удержание.
31. Факторы, учитываемые при принятии решения об удержании рисков.
32. Источники финансирования рисков (текущие доходы, резервы, заемные средства).
33. Особенности формирования резервов в организации,

	<p>преимущества и недостатки.</p> <p>34. Организационно-технические и социально-психологические методы управления рисками.</p> <p>35. Понятие мониторинга рисков.</p> <p>36. Информационная основа мониторинга рисков.</p> <p>37. Основные инструменты мониторинга рисков.</p> <p>38. Установление стандартов, определяющих критерии, по которым можно судить об успешном управлении рисками.</p> <p>39. Корректировка системы управления рисками.</p> <p>40. Основные положения теории принятия решений в условиях риска и неопределенности.</p> <p>41. Матрица решений, ее структура.</p> <p>42. Методика принятия решений в условиях риска.</p> <p>43. Методика принятия решений в условиях неопределенности (критерий Вальда (критерий «максимина»), критерий «максимакса», критерий Гурвица (критерий «оптимизма-пессимизма» или «альфа-критерий»), критерий Сэвиджа (критерий потерь от «минимакса»)).</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

**Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)**  
<https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

. IRR означает - чистая приведённая стоимость

-Верно

-Не верно

. VaR - это статистический финансовый показатель, характеризующий изменчивость цены на что-либо.

-Верно

-Не верно

. Критерий гарантированного результата (максимальный критерий Вальда) является критерием наибольшего вреда;

-Верно

-Не верно

. Графическое представление распределения вероятностей событий осуществляется посредством: гистограммы вероятностей

-Верно

-Не верно

. Под показателем NW в риск-менеджменте понимаются чистые активы

-Верно

-Не верно

. Под термином ALM в риск-менеджменте понимается управление жизненным циклом

-Верно

-Не верно



. Дельта измеряет «течение времени» опциона

-Верно

-Не верно

. Ро измеряет степень чувствительность стоимость опциона к изменениям волатильности базового инструмента.

-Верно

-Не верно

. Критерий максимакса соответствует оптимистической наступательной стратегии; здесь не принимается во внимание никакой возможный результат, кроме самого лучшего

-Верно

-Не верно

. ЕБИТ - прибыль до выплаты процентов.

-Верно

-Не верно

. VAR – это:

- парадигма стоимости риска (Value-at-Risk);

- показатель объемов потерь прибыли (Volume at Reduce);

- степень сопротивления персонала рискованным проектам (Volume at Resistance);

- объем риска (Volume of Accepted Risk).

. Показатель НИ означает:

- чистый приведенный доход

- частые активы

- чистый процентный доход

- непроцентный доход

. Какая из ставок учитывает фактор риска при финансовых расчетах?

- ставка дисконтирования;

- ставка налога на прибыль;

- ставка рефинансирования

- подоходная ставка

. Моделирование методом Монте-Карло предполагает

- 2 этапа

- 3 этапа

- 4 этапа

- 10 шагов

- . Если событие не может произойти ни при каких условиях, его вероятность равна:
  - нулю
  - одному
  - меньше единицы
  - больше единицы
  
- . Близкая к единице прогнозируемость событий соответствует:
  - полной определенности
  - полной неопределенности
  - неизвестности
  - нет правильных вариантов ответов
  
- . Снижение риска за счет увеличения количества поставщиков, позволяющего ослабить зависимость предприятия от конкретного поставщика, - это:
  - диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
  - диверсификация видов хозяйственной деятельности;
  - диверсификация закупок;
  - диверсификация инвестиций.
  
- . Снижение риска за счет распределения готовой продукции предприятия между несколькими рынками или контрагентами - это:
  - диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
  - диверсификация видов хозяйственной деятельности;
  - диверсификация закупок;
  - диверсификация инвестиций.
  
- . Какой метод применяется для моделирования изменений факторов рыночного риска
  - метод исторического моделирования
  - метод наименьших чисел
  - метод экспертных оценок
  - метод Дельфи
  
- . Самым простым индикатором измерения рыночного риска называют
  - VaR
  - Нарисательная сумма
  - BPV
  - BPN
  
- . Какой показатель позволяет определить относительную прибыльность будущего предприятия?
  - PP
  - PI
  - IRR
  - NPV
  
- . Известный метод экспертных оценок для определения исходных данных

предстоящего моделировании инвестиционной программы носит название:

- Паттерн
- метод Дельфи
- метод экспертных оценок
- метод тестирования

### 6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

#### Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме экзамена

Раздел дисциплины	Вопросы
<p>Понятие риска и его функции</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. История риск-менеджмента и современные подходы</li> <li>2. Неопределенность и риск</li> <li>3. Понятие риска и его основные атрибуты. Функции риска</li> <li>4. Классификация рисков</li> <li>5. Понятие менеджмента риска</li> <li>6. Основные свойства управления рисками. Старая и новая парадигмы риск-менеджмента</li> <li>7. Аксиомы и законы риск-менеджмента</li> <li>8. Стандарты риск-менеджмента: ИСО, FERMA, COSO ERM</li> <li>9. Этапы процесса управления рисками</li> <li>10. Организационная структура системы риск-менеджмента</li> <li>11. Функционирование системы риск-менеджмента без создания специального отдела</li> <li>12. Основные функции отдела риск-менеджмента</li> <li>13. Место отдела риск-менеджмента в организационной структуре предприятия (линейная, дивизиональная, матричная)</li> <li>14. Риск-культура: понятие, ключевые элементы</li> <li>15. Риск-аппетит: понятие, особенности формирования</li> <li>16. Аутсорсинг риск-менеджмента</li> <li>17. Система риск-менеджмента в соответствии со стандартом COSO ERM</li> <li>18. Понятие идентификации рисков. Источники информации для идентификации рисков.</li> <li>19. Методы идентификации рисков: мозговой штурм, карточки Крауфорда, метод Дельфи, диаграмма Исикавы</li> <li>20. Цели и сущность количественной оценки рисков</li> <li>21. Статистические методы оценки рисков</li> <li>22. Аналитические методы оценки рисков. Метод оценки платежеспособности и финансовой устойчивости. Анализ точки безубыточности</li> <li>23. Анализ чувствительности. Анализ</li> </ol>

	<p>сценариев</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>24. Экспертный анализ рисков</li> <li>25. Методы управления рисками, их классификация</li> <li>26. Уклонение от рисков</li> <li>27. Методы снижения рисков</li> <li>28. Передача и хеджирование рисков</li> <li>29. Страхование рисков</li> <li>30. Методы удержания рисков</li> <li>31. Организационно-технические и социально-психологические методы управления рисками</li> <li>32. Логика выбора наиболее эффективного метода управления рисками предприятия</li> <li>33. Мониторинг и контроль рисков</li> <li>34. Понятие и виды экологических рисков</li> <li>35. Особенности управления экологическими рисками</li> <li>36. Информационные технологии в области риск-менеджмента</li> <li>37. Принятие решений в условиях неопределенности (критерии Вальда, «максимакса», Гурвица)</li> <li>38. Принятие решений в условиях неопределенности (критерии Сэвиджа, Лапласа)</li> <li>39. Принятие решений в условиях риска</li> <li>40. Стратегии управления рисками</li> </ol>
<p>Основные положения менеджмента риска</p>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. История риск-менеджмента и современные подходы</li> <li>2. Неопределенность и риск</li> <li>3. Понятие риска и его основные атрибуты. Функции риска</li> <li>4. Классификация рисков</li> <li>5. Понятие менеджмента риска</li> <li>6. Основные свойства управления рисками. Старая и новая парадигмы риск-менеджмента</li> <li>7. Аксиомы и законы риск-менеджмента</li> <li>8. Стандарты риск-менеджмента: ИСО, FERMA, COSO ERM</li> <li>9. Этапы процесса управления рисками</li> <li>10. Организационная структура системы риск-менеджмента</li> <li>11. Функционирование системы риск-менеджмента без создания специального отдела</li> <li>12. Основные функции отдела риск-менеджмента</li> <li>13. Место отдела риск-менеджмента в организационной структуре предприятия (линейная, дивизиональная, матричная)</li> <li>14. Риск-культура: понятие, ключевые элементы</li> <li>15. Риск-аппетит: понятие, особенности формирования</li> </ol>

	<p>16. Аутсорсинг риск-менеджмента</p> <p>17. Система риск-менеджмента в соответствии со стандартом COSO ERM</p> <p>18. Понятие идентификации рисков. Источники информации для идентификации рисков.</p> <p>19. Методы идентификации рисков: мозговой штурм, карточки Крауфорда, метод Дельфи, диаграмма Исикавы</p> <p>20. Цели и сущность количественной оценки рисков</p> <p>21. Статистические методы оценки рисков</p> <p>22. Аналитические методы оценки рисков. Метод оценки платежеспособности и финансовой устойчивости. Анализ точки безубыточности</p> <p>23. Анализ чувствительности. Анализ сценариев</p> <p>24. Экспертный анализ рисков</p> <p>25. Методы управления рисками, их классификация</p> <p>26. Уклонение от рисков</p> <p>27. Методы снижения рисков</p> <p>28. Передача и хеджирование рисков</p> <p>29. Страхование рисков</p> <p>30. Методы удержания рисков</p> <p>31. Организационно-технические и социально-психологические методы управления рисками</p> <p>32. Логика выбора наиболее эффективного метода управления рисками предприятия</p> <p>33. Мониторинг и контроль рисков</p> <p>34. Понятие и виды экологических рисков</p> <p>35. Особенности управления экологическими рисками</p> <p>36. Информационные технологии в области риск-менеджмента</p> <p>37. Принятие решений в условиях неопределенности (критерии Вальда, «максимакса», Гурвица)</p> <p>38. Принятие решений в условиях неопределенности (критерии Сэвиджа, Лапласа)</p> <p>39. Принятие решений в условиях риска</p> <p>40. Стратегии управления рисками</p>
--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

#### 6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

##### Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 4-х балльной системы
«отлично»	ПК9з1, ПК9з2, ПК9у1, ПК9у2, ПК9в1, ПК9в2, ПК15з1, ПК15з2, ПК15у1, ПК15у2, ПК15в1, ПК15в2, , , , ПК3в1, ПК3в2
«хорошо»	ПК9з1, ПК9з2, ПК9у1, ПК9в1, ПК15з1, ПК15з2, ПК15у1, ПК15в1, , , , ПК3в1
«удовлетворительно»	ПК9з1, ПК9у1, ПК9в1, ПК15з1, ПК15у1, ПК15в1, , , ПК3в1

<b>«неудовлетворительно»</b>	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне
------------------------------	---------------------------------------------------------