

Рабочая программа дисциплины

Управление рисками (продвинутый уровень)

<i>Направление подготовки</i>	Менеджмент
<i>Код</i>	38.04.02
<i>Направленность (профиль)</i>	Менеджмент в спорте
<i>Квалификация выпускника</i>	магистр
<i>(степень)</i>	

1. Перечень кодов компетенций, формируемых дисциплиной в процессе освоения образовательной программы

Группа компетенций	Категория компетенций	Код
Профессиональные компетенции	-	ПК4
Профессиональные компетенции	-	ПК-8

2. Компетенции и индикаторы их достижения

Код компетенции	Формулировка компетенции	Индикаторы достижения компетенции
ПК-4	Способен участвовать в разработке стратегии управления организацией, используя методы идентификации, оценки ключевых индикаторов и управления рисками	ПК-4.2 Анализирует экономические модели управления хозяйствующих субъектов, с целью выявления рисков при принятии финансовых решений ПК-4.3 Выявление, прогнозирует и оценивает различные виды рисков и их потенциальные последствия для организации
ПК-8	Способен выстраивать систему управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами на основе принципов целеполагания, организационного планирования и прогнозирования	ПК-8.1 Знать жизненный цикл проекта и методический инструментарий, программные продукты координирования деятельности исполнителей и реализации управленческих решений ПК-8.2 Распределять и контролировать использование производственно-технологических ресурсов, выполнять работы по проекту на основе принципов целеполагания, организационного планирования и прогнозирования

3. Описание планируемых результатов обучения по дисциплине

3.1. Описание планируемых результатов обучения по дисциплине

Планируемые результаты обучения по дисциплине представлены дескрипторами (знания, умения, навыки).

Дескрипторы по дисциплине	Знать	Уметь	Владеть
Код компетенции	ПК-4		
Способен участвовать в разработке стратегии управления организацией, используя методы	– теоретические и методологические основы управления рисками; – методы и технологии принятия и реализации управленческих решений;	– применять методологические основы управления рисками; – использовать основные направления и методы принятия и реализации	– методологически ми основами управления рисками; – основными направлениями и методами принятия и реализации управленческих решений;

идентификации, оценки ключевых индикаторов и управления рисками	– приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития организаций; – социальные и экономические методы и механизмы идентификации, оценки ключевых индикаторов и управления рисками	управленческих решений; – учитывать приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития организаций; -оценивать социальные и экономические методы и механизмы идентификации, оценки ключевых индикаторов и управления рисками	– методами по оценки социальных и экономических механизмов идентификации, ключевых индикаторов и рисками
Код компетенции	ПК-8		
Способен выстраивать систему управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами на основе принципов целеполагания, организационного планирования и прогнозирования	- эконометрические методы прогнозирования системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов; - методы стратегического анализа системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами;	- рассчитывать индикаторы устойчивого развития системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами; - осуществлять выбор оптимальных решений при разработке и реализации проектов, программ развития рынка для организационного планирования и прогнозирования на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - применять методы стратегического анализа системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами	- методами прогнозирования и планирования развития системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу. - математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов для организационного планирования и прогнозирования; - методы стратегического анализа системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами

4. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений учебного плана ОПОП.

Данная дисциплина взаимосвязана с другими дисциплинами, такими как: «Принятие и исполнение государственных решений», «Муниципальное управление и местное

самоуправление», «Управление государственным и муниципальным заказом», «Управление отраслевыми комплексами», «Управление государственной и муниципальной собственностью», «Управление в социальной сфере», «Государственно-частное партнерство», «Стратегическое развитие территорий».

В рамках освоения программы магистратура выпускники готовятся к решению задач профессиональной деятельности следующих типов: организационно-управленческий; консультационный и информационно-аналитический; проектный

Профиль (направленность) программы установлена путем ее ориентации на сферу профессиональной деятельности выпускников: Управленческая деятельность в государственных, муниципальных и общественных структурах

5. Объем дисциплины

<i>Виды учебной работы</i>	<i>Формы обучения</i>	
	<i>Очная</i>	<i>Очно-заочная с применением ДОТ</i>
Общая трудоемкость: зачетные единицы/часы	4/144	4/144
Контактная работа:	32	14
Занятия лекционного типа	8	4
Занятия семинарского типа	24	10
Промежуточная аттестация: экзамен	18	18
Самостоятельная работа (СРС)	94	112

6. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам / разделам с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

6.1 Распределение часов по разделам/темам и видам работы

6.1.1 Очная форма обучения

№ п/п	Раздел/тема	Виды учебной работы (в часах)						
		Контактная работа						Самостоятельная работа
		Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа				
		Лекции	Иные учебные занятия	Практические занятия	Семинары	Лабораторные раб.	Иные занятия	
1.	Теоретические основы антикризисного управления. Классификация и виды рисков	2			2			14
2.	Методы анализа и оценки рисков	1			4			16
3.	Финансовые риски: анализ, оценка и подходы к управлению	1			6			16
4.	Организация процесса управления рисками.	2			6			14

5.	Управление операционными рисками				4			20
6.	Учет и оценка рисков инвестиционных проектов	2			2			14
		8			24			94
	Промежуточная аттестация	18						
	Итого	144						

6.1.2 Очно-заочная форма обучения с применением ДОТ

№ п/п	Раздел/тема	Виды учебной работы (в часах)						
		Контактная работа						Самостоят ельная работа
		Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа				
		Лекции	Иные учебные занятия	Практи ческие занятия	Семи нары	Лабор аторн ые раб.	Иные заняти я	
1.	Теоретические основы антикризисного управления. Классификация и виды рисков	2		2				18
2.	Методы анализа и оценки рисков			2				18
3.	Финансовые риски: анализ, оценка и подходы к управлению			2				18
4.	Организация процесса управления рисками.	2		2				18
5.	Управление операционными рисками			1				20
6.	Учет и оценка рисков инвестиционных проектов			1				20
		4		10				112
	Промежуточная аттестация	18						
	Итого	144						

6.2 Программа дисциплины, структурированная по темам / разделам

6.2.1 Содержание лекционного курса

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела дисциплины
----------	---------------------------------	-------------------------------

1.	Теоретические основы антикризисного управления. Классификация и виды рисков	Место и роль рисков в экономической деятельности. Понятие риска как экономической категории. Причины и источники возникновения предпринимательских рисков. Неопределенность и риск, их свойства и отличительные особенности. Сущность риска. Функции риска в экономике. Основные научные концепции риска. Антикризисное управление. Анализ внешней и внутренней среды организации, выявление факторов риска. Модель отраслевых факторов риска Майкла Портера: новый игрок, крупный заказчик, крупный контракт, крупный поставщик, товар-субститут, усиление конкуренции. Факторы риска: нейтивные и интегральные, микроэкономического уровня и макроэкономического уровня, и их разновидности, определенные и неопределенные, случайные и нечеткие, природной, поведенческой и целевой неопределенности. Допустимый риск, критический риск и катастрофический риск. Классификация рисков по причине возникновения: природно-естественные, экологические, транспортные, политические, коммерческие риски (сущность, содержание). Риски, связанные с покупательной способностью денег: инфляционный риск, дефляционный риск, валютный риск, риск ликвидности. Сущность и виды инвестиционных рисков: риск упущенной выгоды; риски, снижения доходности (процентный риск, кредитный риск); риски прямых финансовых потерь (биржевые риски, селективные риски, риск банкротства, кредитный риск). Общие и специфические риски.
2.	Методы анализа и оценки рисков	Идентификация (диагностика) рисков компании. Этапы идентификации рисков. Взаимосвязь стратегического анализа и прогнозирования рисков компании, SWOT-анализ. Качественные методы анализа и оценки рисков. Картографирование, ранжирование рисков, выделение критических рисков. Экспертные процедуры и методы субъективных оценок при прогнозировании и измерении риска. Шкалы риска и характеристика их градаций. Карты и матрицы рисков. Отображение результатов диагностики рисков в разрезе блоков организационной структуры предприятия и по видам риска. Количественные методы оценки рисков. Вероятностные и статистические методы оценки рисков. Показатели чувствительности. Расчетно-аналитический метод, Коэффициент риска. Метод дерева решений и дерева отказов
3.	Финансовые риски: анализ, оценка и подходы к управлению	Рыночные риски, основные виды: валютный, ценовой, процентный. Волатильность. Способы оценки рыночных рисков. Учет рыночных рисков при принятии решения о финансовых вложениях. Мера чувствительности к рыночному риску коэффициент бета. Кредитный риск, сущность и источники возникновения кредитного риска. Три составные части кредитного риска. Определение вероятности дефолта. Ожидаемая

		подверженность кредитному риску. Риск банкротства, его прогнозирование, последствия и процедуры банкротства. Состояние банкротства и его оценка. Юридические последствия банкротства. Государственное регулирование банкротств. Анализ финансового состояния должника арбитражным управляющим. Методы прогнозирования банкротств.
4.	Организация процесса управления рисками.	Основные принципы и подходы к управлению рисками. Интегрированный риск менеджмент. Сущность и содержание риск-менеджмента. Стандарты в области управления рисками. Цели риск-менеджмента. Стратегия и тактика риск-менеджмента. Задачи риск менеджмента. Неразрывность зависимости стратегии и тактики риск-менеджмента. Стратегический риск-менеджмент как система управления риском, основанная на долгосрочном прогнозировании, стратегическом планировании, долговременных целях предприятия. Тактический риск-менеджмент как совокупность приемов и способов, использующихся в конкретной хозяйственной ситуации для достижения целей стратегического риск-менеджмента. Политика и программа управления рисками в компании. Система внутреннего контроля и аудита компании как основа управления и контроля за внутренними рисками компании. Процессный риск-менеджмент. Бизнес-процессы и связанные с ними процедуры анализа и контроля рисков.
5.	Управление операционными рисками	Операционные риски, источники возникновения и виды. Потери, связанные с операционными рисками. Информационная безопасность организации. Охраняемые законом тайны. Информационные риски. Промышленная безопасность и охрана труда. Промышленная безопасность и стратегия управления промышленными рисками. Риск аварий как основной риск критического уровня промышленных предприятий. Опасные производственные объекты (ОПО). Основные законодательные акты в области промышленной безопасности. Организация мероприятий по управлению рисками на ОПО. Экспертиза промышленной безопасности. Деятельность Ростехнадзора по контролю над безопасностью ОПО. Декларация промышленной безопасности. Анализ риска аварий на предприятии. Использование страхования в управлении рисками промышленного предприятия. Требования к охране труда в организации. Государственное регулирование охраны труда и основные законодательные акты по охране труда. Работы с вредными и опасными условиями труда. Классы профессионального риска. Страхование работников. Несчастные случаи на производстве, их расследование и последствия для компании. Затраты на охрану труда
6.	Учет и оценка рисков инвестиционных	Общие закономерности управления инвестиционными проектами. Элементы проектного анализа и стратегия предприятия. Основные методы оценки инвестиционных

	проектов	проектов. Методы учета рисков инвестиционных проектов. Способы учета рисков инвестиционных проектов: безрисковые денежные потоки, скорректированная на риск ставка дисконтирования. Оценка премий за риск. Методы оценки ставки дисконта. Кумулятивное построение ставки дисконтирования. Оценка рисков инвестиционного проекта: анализ безубыточности, анализ чувствительности, анализ сценариев, имитационное моделирование, дерево решений. Особенности метода сценариев и имитационного моделирования. Влияние странового риска на оценку инвестиционных проектов
--	----------	--

6.2.2 Содержание практических занятий

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела дисциплины
1.	Теоретические основы антикризисного управления. Классификация и виды рисков	Понятие риска как экономической категории. Анализ внешней и внутренней среды организации, выявление факторов риска Классификация рисков
2.	Методы анализа и оценки рисков	Качественные методы анализа и оценки рисков. Количественные методы оценки рисков.
3.	Финансовые риски: анализ, оценка и подходы к управлению	Рыночные риски, основные виды: валютный, ценовой, процентный. Волатильность. Способы оценки рыночных рисков. Учет рыночных рисков при принятии решения о финансовых вложениях. Методы и инструменты управления кредитным риском.
4.	Организация процесса управления рисками.	Организация риск-менеджмента на предприятии. Процессный риск менеджмент Управление рисками проекта
5.	Управление операционными рисками	Информационная безопасность организации. Охраняемые законом тайны. Информационные риски. Система информационной безопасности. Виды охраняемых законом тайн. Коммерческая тайна. Режим защиты информации, составляющей коммерческую тайну. Методы защиты информации. Ответственность за разглашение коммерческой тайны. Информационная безопасность организации. Охраняемые законом тайны. Промышленная безопасность и охрана труда.
6.	Учет и оценка рисков инвестиционных проектов	Методы учета рисков инвестиционных проектов.

6.2.3 Содержание самостоятельной работы

№ п/п	Наименование раздела	Содержание раздела дисциплины
--------------	-----------------------------	--------------------------------------

	дисциплины	
1.	Теоретические основы антикризисного управления. Классификация и виды рисков	Место и роль рисков в экономической деятельности. Понятие риска как экономической категории. Причины и источники возникновения предпринимательских рисков. Неопределенность и риск, их свойства и отличительные особенности. Сущность риска. Функции риска в экономике. Основные научные концепции риска. Антикризисное управление. Анализ внешней и внутренней среды организации, выявление факторов риска. Модель отраслевых факторов риска Майкла Портера: новый игрок, крупный заказчик, крупный контракт, крупный поставщик, товар-субститут, усиление конкуренции. Факторы риска: нейтивные и интегральные, микроэкономического уровня и макроэкономического уровня, и их разновидности, определенные и неопределенные, случайные и нечеткие, природной, поведенческой и целевой неопределенности. Допустимый риск, критический риск и катастрофический риск. Классификация рисков по причине возникновения: природно-естественные, экологические, транспортные, политические, коммерческие риски (сущность, содержание). Риски, связанные с покупательной способностью денег: инфляционный риск, дефляционный риск, валютный риск, риск ликвидности. Сущность и виды инвестиционных рисков: риск упущенной выгоды; риски, снижения доходности (процентный риск, кредитный риск); риски прямых финансовых потерь (биржевые риски, селективные риски, риск банкротства, кредитный риск). Общие и специфические риски.
2.	Методы анализа и оценки рисков	Идентификация (диагностика) рисков компании. Этапы идентификации рисков. Взаимосвязь стратегического анализа и прогнозирования рисков компании, SWOT-анализ. Качественные методы анализа и оценки рисков. Картографирование, ранжирование рисков, выделение критических рисков. Экспертные процедуры и методы субъективных оценок при прогнозировании и измерении риска. Шкалы риска и характеристика их градаций. Карты и матрицы рисков. Отображение результатов диагностики рисков в разрезе блоков организационной структуры предприятия и по видам риска. Количественные методы оценки рисков. Вероятностные и статистические методы оценки рисков. Показатели чувствительности. Расчетно-аналитический метод, Коэффициент риска. Метод дерева решений и дерева отказов
3.	Финансовые риски: анализ, оценка и подходы к управлению	Рыночные риски, основные виды: валютный, ценовой, процентный. Волатильность. Способы оценки рыночных рисков. Учет рыночных рисков при принятии решения о финансовых вложениях. Мера чувствительности к рыночному риску коэффициент бета. Кредитный риск, сущность и источники возникновения кредитного риска. Три составные части кредитного риска. Определение вероятности дефолта. Ожидаемая подверженность

		кредитному риску. Риск банкротства, его прогнозирование, последствия и процедуры банкротства. Состояние банкротства и его оценка. Юридические последствия банкротства. Государственное регулирование банкротств. Анализ финансового состояния должника арбитражным управляющим. Методы прогнозирования банкротств.
4.	Организация процесса управления рисками.	Основные принципы и подходы к управлению рисками. Интегрированный риск менеджмент. Сущность и содержание риск-менеджмента. Стандарты в области управления рисками. Цели риск-менеджмента. Стратегия и тактика риск-менеджмента. Задачи риск менеджмента. Неразрывность зависимости стратегии и тактики риск-менеджмента. Стратегический риск-менеджмент как система управления риском, основанная на долгосрочном прогнозировании, стратегическом планировании, долговременных целях предприятия. Тактический риск-менеджмент как совокупность приемов и способов, использующихся в конкретной хозяйственной ситуации для достижения целей стратегического риск-менеджмента. Политика и программа управления рисками в компании. Система внутреннего контроля и аудита компании как основа управления и контроля за внутренними рисками компании. Процессный риск-менеджмент. Бизнес-процессы и связанные с ними процедуры анализа и контроля рисков.
5.	Управление операционными рисками	Операционные риски, источники возникновения и виды. Потери, связанные с операционными рисками. Информационная безопасность организации. Охраняемые законом тайны. Информационные риски. Промышленная безопасность и охрана труда. Промышленная безопасность и стратегия управления промышленными рисками. Риск аварий как основной риск критического уровня промышленных предприятий. Опасные производственные объекты (ОПО). Основные законодательные акты в области промышленной безопасности. Организация мероприятий по управлению рисками на ОПО. Экспертиза промышленной безопасности. Деятельность Ростехнадзора по контролю над безопасностью ОПО. Декларация промышленной безопасности. Анализ риска аварий на предприятии. Использование страхования в управлении рисками промышленного предприятия. Требования к охране труда в организации. Государственное регулирование охраны труда и основные законодательные акты по охране труда. Работы с вредными и опасными условиями труда. Классы профессионального риска. Страхование работников. Несчастные случаи на производстве, их расследование и последствия для компании. Затраты на охрану труда
6.	Учет и оценка рисков инвестиционных проектов	Общие закономерности управления инвестиционными проектами. Элементы проектного анализа и стратегия предприятия. Основные методы оценки инвестиционных проектов.

		Методы учета рисков инвестиционных проектов. Способы учета рисков инвестиционных проектов: безрисковые денежные потоки, скорректированная на риск ставка дисконтирования. Оценка премий за риск. Методы оценки ставки дисконта. Кумулятивное построение ставки дисконтирования. Оценка рисков инвестиционного проекта: анализ безубыточности, анализ чувствительности, анализ сценариев, имитационное моделирование, дерево решений. Особенности метода сценариев и имитационного моделирования. Влияние странового риска на оценку инвестиционных проектов
--	--	---

7. Текущий контроль по дисциплине (модулю) в рамках учебных занятий

В рамках текущего контроля преподаватель самостоятельно может проводить следующие мероприятия:

№ п/п	Контролируемые разделы (темы)	Наименование оценочного средства
1.	Теоретические основы антикризисного управления. Классификация и виды рисков	Опрос, интерактивные задания Реализация программы с применением ДОТ: Тестирование, ситуационные задачи, проблемные задачи
2.	Методы анализа и оценки рисков	Опрос, интерактивные задания, реферат Реализация программы с применением ДОТ: Тестирование, ситуационные задачи, проблемные задачи
3.	Финансовые риски: анализ, оценка и подходы к управлению	Опрос, интерактивные задания, реферат Реализация программы с применением ДОТ: Тестирование, ситуационные задачи, проблемные задачи
4.	Организация процесса управления рисками.	Опрос, интерактивные задания, реферат Реализация программы с применением ДОТ: Тестирование, ситуационные задачи, проблемные задачи
5.	Управление операционными рисками	Опрос, тестирование Реализация программы с применением ДОТ: Тестирование, ситуационные задачи, проблемные задачи
6.	Учет и оценка рисков инвестиционных проектов	Опрос, проблемно-аналитические задания Реализация программы с применением ДОТ: Тестирование, ситуационные задачи, проблемные задачи

8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

8.1 Основная учебная литература

1. Черняева, С. Н. Управление рисками. Практикум: учебное пособие / С. Н. Черняева, Л. А. Коробова, И. С. Толстова. — Воронеж: Воронежский государственный университет инженерных технологий, 2022. — 91 с. — ISBN 978-5-00032-574-2. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL:

<https://www.iprbookshop.ru/122601.html>

2. Авдийский, В. И. Современные научные подходы к разработке систем минимизации рисков в деятельности хозяйствующих субъектов : монография / В. И. Авдийский, В. М. Безденежных, Н. Г. Синявский. — 2-е изд. — Москва : Научный консультант, 2024. — 256 с. — ISBN 978-5-907196-34-6. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/140410.html> (дата обращения: 06.05.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

3. Основы инвестиционно-инновационного риск-менеджмента в системе управления хозяйствующими субъектами России : монография / А. Т. Алиев, К. В. Балдин, Е. Н. Романов, Н. Б. Москалева. — Москва : Дашков и К, 2023. — 484 с. — ISBN 978-5-394-05459-4. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/136496.html> (дата обращения: 06.05.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

8.2 Дополнительная учебная литература:

1. Рощина, Ю. В. Управление банковскими и кредитными рисками : учебное пособие / Ю. В. Рощина. — Симферополь : Университет экономики и управления, 2022. — 65 с. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/124419.html> (дата обращения: 06.05.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

2. Киселев, И. А. Правовые проблемы управления корпоративными рисками в целях противодействия отмыванию денег и финансированию терроризма : монография / И. А. Киселев, И. А. Лебедев, Д. В. Никитин ; под редакцией В. И. Авдийского. — 2-е изд. — Москва : Юриспруденция, 2023. — 168 с. — ISBN 978-5-9516-0576-4. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/136096.html> (дата обращения: 06.05.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

3. Логанина, В. И. Управление рисками в системе менеджмента качества : учебное пособие по направлению подготовки 27.03.02 «Управление качеством» / В. И. Логанина, Т. В. Учаева. — Пенза : Пензенский государственный университет архитектуры и строительства, ЭБС АСВ, 2021. — 128 с. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/138671.html> (дата обращения: 06.05.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

8.3. Периодические издания

1. Проблемы управления <http://www.iprbookshop.ru/8533.html>

2. Управление большими системами <http://www.iprbookshop.ru/8536.html>

3. Управление в современных системах <http://www.iprbookshop.ru/80256.html>

4. Государственное и муниципальное управление. Ученые записки
<http://www.iprbookshop.ru/82793.html>

5. Вопросы управления <http://www.iprbookshop.ru/87622.html>

9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее - сеть «Интернет»), необходимых для освоения дисциплины (модуля)

1. Федеральный портал «Российское образование» <http://www.edu.ru/>

2. Федеральное хранилище «Единая коллекция цифровых образовательных ресурсов»
<http://school-collection.edu.ru/>

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

Успешное освоение данного курса базируется на рациональном сочетании нескольких видов учебной деятельности – лекций, семинарских занятий, самостоятельной работы. При этом самостоятельную работу следует рассматривать одним из главных звеньев

полноценного высшего образования, на которую отводится значительная часть учебного времени.

Самостоятельная работа студентов складывается из следующих составляющих:

- работа с основной и дополнительной литературой, с материалами интернета и конспектами лекций;
- внеаудиторная подготовка к контрольным работам, выполнение докладов, рефератов и курсовых работ;
- выполнение самостоятельных практических работ;
- подготовка к экзаменам (зачетам) непосредственно перед ними.

Для правильной организации работы необходимо учитывать порядок изучения разделов курса, находящихся в строгой логической последовательности. Поэтому хорошее усвоение одной части дисциплины является предпосылкой для успешного перехода к следующей. Задания, проблемные вопросы, предложенные для изучения дисциплины, в том числе и для самостоятельного выполнения, носят междисциплинарный характер и базируются, прежде всего, на причинно-следственных связях между компонентами окружающего нас мира. В течение семестра, необходимо подготовить рефераты (проекты) с использованием рекомендуемой основной и дополнительной литературы и сдать рефераты для проверки преподавателю. Важным составляющим в изучении данного курса является решение ситуационных задач и работа над проблемно-аналитическими заданиями, что предполагает знание соответствующей научной терминологии и т.д.

Для лучшего запоминания материала целесообразно использовать индивидуальные особенности и разные виды памяти: зрительную, слуховую, ассоциативную. Успешному запоминанию также способствует приведение ярких свидетельств и наглядных примеров. Учебный материал должен постоянно повторяться и закрепляться.

При выполнении докладов, творческих, информационных, исследовательских проектов особое внимание следует обращать на подбор источников информации и методику работы с ними.

Для успешной сдачи экзамена (зачета) рекомендуется соблюдать следующие правила:

1. Подготовка к экзамену (зачету) должна проводиться систематически, в течение всего семестра.
2. Интенсивная подготовка должна начаться не позднее, чем за месяц до экзамена.
3. Время непосредственно перед экзаменом (зачетом) лучше использовать таким образом, чтобы оставить последний день свободным для повторения курса в целом, для систематизации материала и доработки отдельных вопросов.

На экзамене высокую оценку получают студенты, использующие данные, полученные в процессе выполнения самостоятельных работ, а также использующие собственные выводы на основе изученного материала.

Учитывая значительный объем теоретического материала, студентам рекомендуется регулярное посещение и подробное конспектирование лекций.

11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

1. Microsoft Windows Server;
 2. Семейство ОС Microsoft Windows;
 3. Libre Office свободно распространяемый офисный пакет с открытым исходным кодом;
 4. Информационно-справочная система: Система КонсультантПлюс (КонсультантПлюс);
 5. Информационно-правовое обеспечение Гарант: Электронный периодический справочник «Система ГАРАНТ» (Система ГАРАНТ);
 6. Электронная информационно-образовательная система ММУ: <https://elearn.mmu.ru/>
- Перечень используемого программного обеспечения указан в п.12 данной рабочей программы дисциплины.

12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

12.1. Учебная аудитория для проведения учебных занятий, предусмотренных программой бакалавриата, оснащенная оборудованием и техническими средствами обучения.

Специализированная мебель:

Комплект учебной мебели (стол, стул) по количеству обучающихся; комплект мебели для преподавателя; доска (маркерная).

Технические средства обучения:

Компьютер в сборе для преподавателя, проектор, экран, колонки

Перечень лицензионного программного обеспечения, в том числе отечественного производства:

Windows 10, КонсультантПлюс, Система ГАРАНТ, Kaspersky Endpoint Security.

Перечень свободно распространяемого программного обеспечения:

Яндекс Браузер, LibreOffice, МТС Линк.

Подключение к сети «Интернет» и обеспечение доступа в электронную информационно-образовательную среду ММУ.

12.2. Помещение для самостоятельной работы обучающихся.

Специализированная мебель:

Комплект учебной мебели (стол, стул) по количеству обучающихся; комплект мебели для преподавателя; доска (маркерная).

Технические средства обучения:

Компьютер в сборе для преподавателя; компьютеры в сборе для обучающихся; колонки; проектор, экран.

Перечень лицензионного программного обеспечения, в том числе отечественного производства:

Windows Server 2016, Windows 10, Microsoft Office, КонсультантПлюс, Kaspersky Endpoint Security.

Перечень свободно распространяемого программного обеспечения:

Яндекс Браузер, LibreOffice, МТС Линк, Gimp, Paint.net, AnyLogic, Inkscape.

Помещение для самостоятельной работы обучающихся оснащено компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду ММУ.

13. Образовательные технологии, используемые при освоении дисциплины

Для освоения дисциплины используются как традиционные формы занятий – лекции (типы лекций – установочная, вводная, текущая, заключительная, обзорная; виды лекций – проблемная, визуальная, лекция конференция, лекция консультация); и семинарские (практические) занятия, так и активные и интерактивные формы занятий - деловые и ролевые игры, решение ситуационных задач и разбор конкретных ситуаций.

На учебных занятиях используются технические средства обучения мультимедийной аудитории: компьютер, монитор, колонки, настенный экран, проектор, микрофон, пакет программ Microsoft Office для демонстрации презентаций и медиафайлов, видеопроектор для демонстрации слайдов, видеосюжетов и др. Тестирование обучаемых может осуществляться с использованием компьютерного оборудования университета.

13.1. В освоении учебной дисциплины используются следующие традиционные образовательные технологии:

- чтение проблемно-информационных лекций с использованием доски и видеоматериалов;

- семинарские занятия для обсуждения, дискуссий и обмена мнениями;
- контрольные опросы;
- консультации;
- самостоятельная работа студентов с учебной литературой и первоисточниками;
- подготовка и обсуждение рефератов (проектов), презентаций (научно-исследовательская работа);
- тестирование по основным темам дисциплины.

13.2. Активные и интерактивные методы и формы обучения

Из перечня видов: (*«мозговой штурм», анализ НПА, анализ проблемных ситуаций, анализ конкретных ситуаций, инциденты, имитация коллективной профессиональной деятельности, разыгрывание ролей, творческая работа, связанная с освоением дисциплины, ролевая игра, круглый стол, диспут, беседа, дискуссия, мини-конференция и др.*) используются следующие:

- *анализ проблемных, творческих заданий, ситуационных задач*
- *ролевая игра;*
- *круглый стол;*
- *мини-конференция;*
- *дискуссия;*
- *беседа.*

13.3. Особенности обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья (ОВЗ)

При организации обучения по дисциплине учитываются особенности организации взаимодействия с инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья (далее – инвалиды и лица с ОВЗ) с целью обеспечения их прав, разрабатываются адаптированные для инвалидов программы подготовки с учетом различных нозологий, виды и формы сопровождения обучения, используются специальные технические и программные средства обучения, дистанционные образовательные технологии, обеспечивается безбарьерная среда и прочее.

Выбор методов обучения определяется содержанием обучения, уровнем методического и материально-технического обеспечения, особенностями восприятия учебной информации студентов-инвалидов и студентов с ограниченными возможностями здоровья и т.д. В образовательном процессе используются социально-активные и рефлексивные методы обучения, технологии социокультурной реабилитации с целью оказания помощи в установлении полноценных межличностных отношений с другими студентами, создании комфортного психологического климата в студенческой группе.

При обучении лиц с ограниченными возможностями здоровья электронное обучение и дистанционные образовательные технологии предусматривают возможность приема-передачи информации в доступных для них формах.

Обучающиеся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья обеспечены печатными и электронными образовательными ресурсами в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья.

Автономная некоммерческая организация высшего образования
«МОСКОВСКИЙ МЕЖДУНАРОДНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ
ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Управление рисками (продвинутый уровень)

<i>Направление подготовки</i>	Менеджмент
<i>Код</i>	38.04.02
<i>Направленность (профиль)</i>	Операционное и стратегическое управление
<i>Квалификация выпускника</i> (степень)	магистр

1. Перечень кодов компетенций, формируемых дисциплиной в процессе освоения образовательной программы

Группа компетенций	Категория компетенций	Код
Профессиональные компетенции	-	ПК - 4
Профессиональные компетенции	-	ПК - 8

2. Компетенции и индикаторы их достижения

Код компетенции	Формулировка компетенции	Индикаторы достижения компетенции
ПК-4	Способен участвовать в разработке стратегии управления организацией, используя методы идентификации, оценки ключевых индикаторов и управления рисками	ПК-4.2 Анализирует экономические модели управления хозяйствующих субъектов, с целью выявления рисков при принятии финансовых решений ПК-4.3 Выявление, прогнозирует и оценивает различные виды рисков и их потенциальные последствия для организации
ПК-8	Способен выстраивать систему управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами на основе принципов целеполагания, организационного планирования и прогнозирования	ПК-8.1 Знать жизненный цикл проекта и методический инструментарий, программные продукты координирования деятельности исполнителей и реализации управленческих решений ПК-8.2 Распределять и контролировать использование производственно-технологических ресурсов, выполнять работы по проекту на основе принципов целеполагания, организационного планирования и прогнозирования

3. Описание планируемых результатов обучения по дисциплине

3.1. Описание планируемых результатов обучения по дисциплине

Планируемые результаты обучения по дисциплине представлены дескрипторами (знания, умения, навыки).

Дескрипторы по дисциплине	Знать	Уметь	Владеть
Код компетенции	ПК-4		
Способен участвовать в разработке стратегии управления организацией, используя методы	– теоретические и методологические основы управления рисками; – методы и технологии принятия и реализации управленческих решений;	– применять методологические основы управления рисками; – использовать основные направления и методы принятия и реализации	– методологически ми основами управления рисками; – основными направлениями и методами принятия и реализации управленческих решений;

идентификации, оценки ключевых индикаторов и управления рисками	– приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития организаций; – социальные и экономические методы и механизмы идентификации, оценки ключевых индикаторов и управления рисками	управленческих решений; – учитывать приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития организаций; -оценивать социальные и экономические методы и механизмы идентификации, оценки ключевых индикаторов и управления рисками	– методами по оценке социальных и экономических механизмов идентификации, ключевых индикаторов и рисками
Код компетенции	ПК-8		
Способен выстраивать систему управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами на основе принципов целеполагания, организационного планирования и прогнозирования	- эконометрические методы прогнозирования системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов; - методы стратегического анализа системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами;	- рассчитывать индикаторы устойчивого развития системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами; - осуществлять выбор оптимальных решений при разработке и реализации проектов, программ развития рынка для организационного планирования и прогнозирования на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - применять методы стратегического анализа системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами	- методами прогнозирования и планирования развития системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу. - математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов для организационного планирования и прогнозирования; - методы стратегического анализа системы управления проектами в соответствии с национальными и международными стандартами

3.2. Критерии оценки знаний студентов

Шкала оценивания	Индикаторы достижения	Показатели оценивания результатов обучения
ОТЛИЧНО/Зачтено	Знает:	- студент глубоко и всесторонне усвоил материал, уверенно, логично, последовательно и грамотно его излагает, опираясь на знания основной и дополнительной литературы, - на основе системных научных знаний делает квалифицированные выводы и обобщения, свободно оперирует категориями и понятиями.
	Умеет:	- студент умеет самостоятельно и правильно решать учебно-профессиональные задачи или задания, уверенно, логично, последовательно и аргументировано излагать свое решение, используя научные понятия, ссылаясь на нормативную базу.
	Владеет:	- студент владеет рациональными методами (с использованием рациональных методик) решения сложных профессиональных задач, представленных деловыми играми, кейсами и т.д.; - При решении продемонстрировал навыки - выделения главного, - связкой теоретических положений с требованиями руководящих документов, - изложения мыслей в логической последовательности, - самостоятельного анализа факты, событий, явлений, процессов в их взаимосвязи и диалектическом развитии.
ХОРОШО/Зачтено	Знает:	- студент твердо усвоил материал, достаточно грамотно его излагает, опираясь на знания основной и дополнительной литературы, - затрудняется в формулировании квалифицированных выводов и обобщений, оперирует категориями и понятиями, но не всегда правильно их верифицирует.
	Умеет:	- студент умеет самостоятельно и в основном правильно решать учебно-профессиональные задачи или задания, уверенно, логично, последовательно и аргументировано излагать свое решение, не в полной мере используя научные понятия и ссылки на нормативную базу.
	Владеет:	- студент в целом владеет рациональными методами решения сложных профессиональных задач, представленных деловыми играми, кейсами и т.д.; - При решении смог продемонстрировать достаточность, но не глубинность навыков - выделения главного, - изложения мыслей в логической последовательности. - связки теоретических положений с требованиями руководящих документов, - самостоятельного анализа факты, событий, явлений, процессов в их взаимосвязи и диалектическом развитии.

УДОВЛЕТВОРИТЕЛЬНО/Зачтено	Знает:	- студент ориентируется в материале, однако затрудняется в его изложении; - показывает недостаточность знаний основной и дополнительной литературы; - слабо аргументирует научные положения; - практически не способен сформулировать выводы и обобщения; - частично владеет системой понятий.
	Умеет:	- студент в основном умеет решить учебно-профессиональную задачу или задание, но допускает ошибки, слабо аргументирует свое решение, недостаточно использует научные понятия и руководящие документы.
	Владеет:	- студент владеет некоторыми рациональными методами решения сложных профессиональных задач, представленных деловыми играми, кейсами и т.д.; При решении продемонстрировал недостаточность навыков - выделения главного, - изложения мыслей в логической последовательности. - связки теоретических положений с требованиями руководящих документов, - самостоятельного анализа факты, событий, явлений, процессов в их взаимосвязи и диалектическом развитии.
НЕУДОВЛЕТВОРИТЕЛЬНО/Не зачтено	Знает:	- студент не усвоил значительной части материала; - не может аргументировать научные положения; - не формулирует квалифицированных выводов и обобщений; - не владеет системой понятий.
	Умеет:	студент не показал умение решать учебно-профессиональную задачу или задание.
	Владеет:	не выполнены требования, предъявляемые к навыкам, оцениваемым “удовлетворительно”.

При ответе на вопросы в рамках прохождения промежуточной аттестации (зачет/зачет с оценкой/ экзамен) допускается вольная формулировка ответа, по смыслу раскрывающая содержание ответа, указанного в фонде оценочных средств, в качестве верного ответа.

4. Типовые контрольные задания (закрытого, открытого и иного типа) для проведения промежуточной аттестации, необходимые для оценки достижения компетенции, соотнесенной с результатами обучения по дисциплине

ТЕСТИРОВАНИЕ
2 СЕМЕСТР
ПК4

1. В страховании жизни применяются такие страховые понятия, как
(отметьте правильный ответ):

- а) условная и безусловная франшиза
- б) переход к страховщику прав страхователя на возмещение ущерба (суброгация)
- в) страховая сумма**
- г) страховое возмещение

Ответ: в

2. Какие потери можно обозначить как трудовые?

- а) потери рабочего времени**
- б) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
- в) уплата дополнительных налогов
- г) невыполнение сроков сдачи объекта
- д) потери материалов

Ответ: а

3. В основе какой из ниже предложенных операции лежит обмен финансовыми активами или обязательствами для улучшения их структуры и снижения возможных потерь:

- а) своп;**
- б) хеджирование;
- в) репо.
- г) нет правильного ответа

Ответ: а

4. Как называются риски, которые обусловлены деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией?

- а) внешними
- б) внутренними**
- в) чистыми
- г) нет правильного ответа

Ответ: б

5. Утверждение о том, что «практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» отражает смысл...

- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- б) закона неизбежности риска
- в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
- г) нет правильного ответа

6. Риск – это...

- а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная**

возможность получения неопределенных результатов различного характера

г) нет правильного ответа

Ответ: в

7.Отметьте потери, которые можно отнести к трудовым

а) потери рабочего времени

б) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

в) уплата дополнительных налогов

г) невыполнение сроков сдачи объекта

д) потери материалов

Ответ: а

8.Социально-экономическая функция риска состоит

а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике — отрасли деятельности, в которых риск приемлем

б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода

в) оба варианта верны

г) нет правильного ответа

Ответ: а

9. Близкая к единице прогнозируемость событий соответствует _____ (2 слова)

Ответ: полной определенности

10. В соответствии с математической теорией вероятности, процесс проведения программы инвестирования по всей совокупности это _____ (2 слова)

Ответ: составные события

11. При получении банковского кредита под инвестиционную программу могут возникнуть неопределенности:

а) неопределенность в ожидаемых сроках поступлений денежных средств на счет фирмы;

б) неопределенность периода погашения ссуды;

в) неопределенность абсолютного количества денежных средств, уплачиваемых за использование банковского кредита;

г) все ответы верны

Ответ: г

12.Основой финансовой системы РФ является:

а) федеральный бюджет

б) бюджетная система

в) бюджетная система и внебюджетные фонды

г) финансы предприятий и финансы домохозяйств

Ответ: г

13. Выберите верное утверждение:

а) Вексель может быть составлен в письменной форме или в форме электронного документа

б) Вексель может быть составлен только на бумажном носителе

в) Вексель может быть составлен в устной или письменной форме

г) Ни один из указанных выше ответов не является верным

Ответ: б

14. Какой из перечисленных ниже страховых терминов не может обозначать страховщика или перестраховщика?

- а) Цедент
- б) Эксцедент**
- в) Ретроцедент
- г) Перестрахователь

Ответ: б

15. Задание на соответствие. Установить соответствие между фактором риска и примером его проявления

1	Социально-экономическая функция риска	А	построение дерева решений
2	Социально-экономическая функция риска	Б	Начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик
3	метод оценки риска	В	В процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике — отрасли деятельности, в которых риск приемлем

Ответ: 1-Б, 2-В, 3-А

2 СЕМЕСТР ПК8

1. Денежная форма ущерба называется

- а) убытком**
- б) упущенной выгодой
- в) финансовыми потерями
- г) нет правильного ответа

Ответ: а

2. Собственный капитал банка по российской финансовой отчетности включает:

- а) акционерный капитал
- б) добавочный капитал**
- в) фонды из прибыли
- г) а, б, в
- д) нет правильного ответа

Ответ: б

3. Форма безналичных расчетов, обеспечивающая гарантию платежа, — это:

- а) платежное поручение
- б) аккредитив**
- в) чек
- г) расчеты по инкассо

Ответ: б

4. Какие подходы выделяют при расчете VAR?

- а) эмпирический;
- б) логический;
- в) оценочный;
- г) ранжирование;
- д) параметрический.

Ответ: а, д

5. Инструменты денежного рынка имеют следующие характерные черты:

- а) краткосрочность
- б) высокая ликвидность
- в) низкая рискованность
- г) все перечисленное верно

Ответ: г

6. В чем заключается отличие «прямого финансирования» от «косвенного финансирования»?

- а) «Прямое финансирование» предполагает финансирование со стороны государственных институтов, «косвенное финансирование» — со стороны частного сектора
- б) «Прямое финансирование» подлежит налогообложению; «косвенное финансирование» — освобождено от налогообложения
- в) «Прямое финансирование» — финансирование на биржевом рынке; «косвенное финансирование» — финансирование на внебиржевом рынке
- г) «Прямое финансирование» предполагает получение средств непосредственно от кредиторов (инвесторов); «косвенное финансирование» — с помощью финансовых посредников

Ответ: г

7. Какое утверждение неверно?

- а) облигации с более высокой купонной ставкой имеют меньшее значение срока возмещения при одинаковом сроке погашения
- б) у облигаций с промежуточными выплатами срок возмещения всегда больше срока погашения
- в) Для одной и той же облигации срок возмещения будет тем больше, чем меньшее значение имеет рыночная ставка процента
- г) существует прямая зависимость между сроком погашения и сроком возмещения

Ответ: б

8. Риск купонной облигации, связанный с тем, что рыночная ставка может измениться, и не связанный с изменением цены облигации:

- а) риск реинвестирования
- б) риск дефолта
- в) курсовой риск
- г) риск ликвидности

Ответ: а

9. Что такое последствия риска?

- а) скорее положительными
- б) как положительными, так и отрицательными
- в) только отрицательными
- г) нет правильного ответа

Ответ: б

10. Как называются риски, которые практически всегда несут в себе потери?

- а) критическими
- б) спекулятивными
- в) чистыми**
- г) нет правильного ответа

Ответ: в

11. Риски, обусловленные деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией, называются

- а) внешними
- б) внутренними**
- в) чистыми
- г) нет правильного ответа

Ответ: б

12. Утверждение о том, что «деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» отражает смысл...

- а) закона неизбежности риска**
- б) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
- в) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- г) нет правильного ответа

Ответ: а

13. Утверждение о том, что «чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» отражает смысл...

- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов**
- б) закона неизбежности риска
- в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
- г) нет правильного ответа

Ответ: а

14. Риски, в результате реализации, которых предприятию грозит потеря выручки (т.е. потери превышают ожидаемую прибыль), называются:

- а) катастрофическими
- б) критическими**
- в) допустимыми
- г) нет правильного ответа

Ответ: б

15. Задание на соответствие. Установите соответствие между риском и управления в риск-менеджменте

1	Субъект управления в риск-менеджменте	А	Следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера
2	метод обучения и инструктирования персонала:	Б	Специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

3	определение термина «риск»	В	Метод компенсации рисков
---	----------------------------	---	--------------------------

Ответ: 1-Б, 2-В, 3-А