

Рабочая программа дисциплины

Управление рисками

<i>Направление подготовки</i>	Государственное и муниципальное управление
<i>Код</i>	38.04.04
<i>Направленность (профиль)</i>	Управленческая деятельность в государственных, муниципальных и общественных структурах
<i>Квалификация выпускника</i>	(степень) магистр

Москва
2026

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

Группа компетенций	Категория компетенций	Код
Профессиональные	-	ПК-2;
Профессиональные		ПК-7;
Профессиональные		ПК-9

2. Компетенции и индикаторы их достижения

Код компетенции	Формулировка компетенции	Индикаторы достижения компетенции
ПК-2	Владение организационными способностями, умением находить и принимать организационные управленческие решения, в том числе в кризисных ситуациях	ПК-2.1 Использует организаторские способности для реализации управленческих решений ПК-2.2 Принимает эффективные управленческие решения в различных сферах профессиональной деятельности ПК-2.3 Оценивает последствия принимаемых решений с учетом кризисной ситуации
ПК-7	ПК-7 Способен определять приоритеты профессиональной деятельности, разрабатывать социально-экономические программы развития, оценивать экономические, социальные, политические условия и последствия реализации государственных (муниципальных) программ	ПК-7.1 Определяет приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития территории ПК-7.2 Разрабатывает социально-экономические программы развития территории с учетом динамичных изменений внешней среды ПК-7.3 Применяет социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах ПК-7.4 Оценивает экономические, социальные, политические условия и последствия реализации государственных (муниципальных) программ
ПК-9	ПК-9 Способен использовать эконометрические методы прогнозирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу	ПК-9.1 Использует эконометрические методы прогнозирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу ПК-9.2 Применяет математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов на отраслевых, региональных и народнохозяйственном уровнях для научного обоснования направления стратегического развития социально-экономической системы ПК-9.3 Проводит расчеты показателей, критериев и индикаторов с целью выбора оптимальных решений при разработке и реализации проектов, программ развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу

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-2		
	– теоретические и методологические основы управления рисками; – основные направления социо-экономической политики РФ; – методы и технологии принятия и реализации государственных решений; – приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития территории; – социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах	- использовать организаторские способности для реализации управленческих решений; - принимать эффективные управленческие решения в различных сферах профессиональной деятельности; - оценивать экономические, социальные, политические условия и последствия реализации государственных (муниципальных) программ	– теоретические и методологические основы управления рисками; – основные направления социо-экономической политики РФ; – методы и технологии принятия и реализации государственных решений; – приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития территории; – социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах
Код компетенции	ПК-7		
	– основные направления социо-экономической политики РФ; – взаимосвязь всех подсистем управления в обеспечении социально-экономического развития территории; – приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-	- определять приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития территории; - разрабатывать социально-экономические программы развития территории с учетом динамичных изменений внешней среды и приоритетов профессиональной	– навыками анализа и прогнозирования направлений развития территорий; - навыками оценки экологических последствий от различных видов деятельности; - методами оценки экономических, социальных, политических условий и последствий реализации

	экономических программ развития территории; – методы анализа и оценки внешней среды; – социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах	деятельности; - применять социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах; - оценивать экономические, социальные, политические условия и последствия реализации государственных (муниципальных) программ	государственных (муниципальных) программ; - навыками оценки качества жизни населения как социально-экономической характеристики развития территории
Код компетенции	ПК-9		
	- эконометрические методы прогнозирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов на отраслевых, региональных уровнях; - методы стратегического анализа; - основы государственно-частного партнерства эконометрические методы прогнозирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов на	- рассчитывать индикаторы устойчивого развития территории; - осуществлять выбор оптимальных решений при разработке и реализации проектов, программ развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - разрабатывать программы развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу.	- методами прогнозирования и планирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу.

	отраслевых, региональных уровнях; - методы стратегического анализа; - основы государственно- частного партнерства.		
--	---	--	--

4. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина относится к дисциплинам базовой вариативной 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	27
Самостоятельная работа (СРС)	94	103

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	Практические	Семинары		Лабораторн

			занятия	занятия		ые раб.	я	
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						Самостоя тельная 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				17
3.	Финансовые риски: анализ, оценка и подходы к управлению			2				17
4.	Организация процесса управления рисками.	2		2				17
5.	Управление операционными рисками			1				17
6.	Учет и оценка рисков инвестиционных			1				17

	проектов							
		4		10				103
	Промежуточная аттестация	27						
	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 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

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 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, долгосрочных 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

		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. Афонин П.Н. Система управления рисками: учебное пособие / Афонин П.Н. — Санкт-Петербург: Троицкий мост, 2016. — 125 с. — ISBN 978-5-4377-0067-9. — Текст: электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS: [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/42738.html>
2. Балдин К.В. Управление рисками: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления (060000) / Балдин К.В., Воробьев С.Н. — Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 511 с. — ISBN 5-238-00861-9. — Текст: электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS: [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/71229.html>
3. Кулешова Е.В. Управление рисками проектов: учебное пособие / Кулешова Е.В.. — Томск: Томский государственный университет систем управления и радиоэлектроники, Эль Контент, 2015. — 188 с. — ISBN 978-5-4332-0251-1. — Текст: электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS: [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/72205.html>

8.2 Дополнительная учебная литература:

4. Титаренко Б.П. Управление рисками в инновационных проектах: монография / Титаренко Б.П. — Москва: Московский государственный строительный университет, ЭБС АСВ, 2011. — 144 с. — ISBN 978-5-7264-0548-3. — Текст: электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS: [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/16322.html>
5. Управление инвестициями. Управление персоналом. Основы управления персоналом. Управление проектами. Управление рисками. Выпуск 6: глоссарий / В.А. Пономарев [и др.]. — Москва: Московский гуманитарный университет, 2013. — 216 с. — ISBN 978-5-98079-918-2. — Текст: электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/22466.html>

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:

1. работа с основной и дополнительной литературой, с материалами интернета и конспектами лекций;
2. внеаудиторная подготовка к контрольным работам, выполнение докладов, рефератов и курсовых работ;
3. выполнение самостоятельных практических работ;
4. 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. Терминальный сервер, предоставляющий к нему доступ клиентам на базе Windows Server 2016
2. Семейство ОС Microsoft Windows
3. Libre Office свободно распространяемый офисный пакет с открытым исходным кодом
4. Информационно-справочная система: Система КонсультантПлюс (Информационный комплекс)
5. Информационно-правовое обеспечение Гарант: Электронный периодический справочник «Система ГАРАНТ» (ЭПС «Система ГАРАНТ»)

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, оснащенная оборудованием и техническими средствами обучения.

Специализированная мебель:

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

Технические средства обучения:

Компьютер в сборе для преподавателя, проектор, экран, колонки

Перечень лицензионного программного обеспечения, в том числе отечественного производства:

Операционные системы семейства Windows, КонсультантПлюс веб версия, Гарант веб версия, антивирус Kaspersky Endpoint Security.

Перечень свободно распространяемого программного обеспечения:

Яндекс Браузер, LibreOffice, МТС Линк, VLC Media Player.

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; доска (маркерная), комплект мебели для преподавателя.

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:

Операционные системы семейства Windows, КонсультантПлюс веб версия, Гарант веб версия, антивирус Kaspersky Endpoint Security.

Перечень свободно распространяемого программного обеспечения:

Яндекс Браузер, LibreOffice, МТС Линк, Notepad++. Pinta, Gimp, AnyLogic, Inkscape, OpenShot. FreeCAD, LibreCAD, Jamovi, Visual Studio, Unity.

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 MicrosoftOffice 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:

- диспут
- 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. При обучении учитываются особенности их психофизического развития, индивидуальные возможности и при необходимости обеспечивается коррекция нарушений развития и социальная адаптация указанных лиц.

Выбор методов обучения определяется содержанием обучения, уровнем методического и материально-технического обеспечения, особенностями восприятия учебной информации студентами-инвалидами и студентами 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

<i>Направление подготовки</i>	Государственное и муниципальное управление
Код	38.04.04
<i>Направленность (профиль)</i>	Управленческая деятельность в государственных, муниципальных и общественных структурах
<i>Квалификация выпускника</i>	(степень) магистр

Москва
2026

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

Группа компетенций	Категория компетенций	Код
Профессиональные	-	ПК-2;
Профессиональные		ПК-7;
Профессиональные		ПК-9

2. Компетенции и индикаторы их достижения

Код компетенции	Формулировка компетенции	Индикаторы достижения компетенции
ПК-2	Владение организационными способностями, умением находить и принимать организационные управленческие решения, в том числе в кризисных ситуациях	ПК-2.1 Использует организаторские способности для реализации управленческих решений ПК-2.2 Принимает эффективные управленческие решения в различных сферах профессиональной деятельности ПК-3.2 Оценивает последствия принимаемых решений с учетом кризисной ситуации
ПК-7	ПК-7 Способен определять приоритеты профессиональной деятельности, разрабатывать социально-экономические программы развития, оценивать экономические, социальные, политические условия и последствия реализации государственных (муниципальных) программ	ПК-7.1 Определяет приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития территории ПК-7.2 Разрабатывает социально-экономические программы развития территории с учетом динамичных изменений внешней среды ПК-7.3 Применяет социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах ПК-7.4 Оценивает экономические, социальные, политические условия и последствия реализации государственных (муниципальных) программ
ПК-9	ПК-9 Способен использовать эконометрические методы прогнозирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу	ПК-9.1 Использует эконометрические методы прогнозирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу ПК-9.2 Применяет математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов на отраслевых, региональных и народнохозяйственном уровнях для научного обоснования направления стратегического развития социально-экономической систем ПК-9.3 Проводит расчеты показателей, критериев и индикаторов с целью выбора оптимальных решений при разработке и реализации проектов, программ развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу

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-2		
	– теоретические и методологические основы управления рисками; – основные направления социо-экономической политики РФ; – методы и технологии принятия и реализации государственных решений; – приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития территории; – социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах	- использовать организаторские способности для реализации управленческих решений; - принимать эффективные управленческие решения в различных сферах профессиональной деятельности; - оценивать экономические, социальные, политические условия и последствия реализации государственных (муниципальных) программ	– теоретические и методологические основы управления рисками; – основные направления социо-экономической политики РФ; – методы и технологии принятия и реализации государственных решений; – приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития территории; – социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах
Код компетенции	ПК-7		
	– основные направления социо-экономической политики РФ; – взаимосвязь всех подсистем управления в обеспечении социально-экономического развития территории; – приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-	- определять приоритеты профессиональной деятельности при разработке социально-экономических программ развития территории; - разрабатывать социально-экономические программы развития территории с учетом динамичных изменений внешней среды и приоритетов профессиональной	– навыками анализа и прогнозирования направлений развития территорий; - навыками оценки экологических последствий от различных видов деятельности; - методами оценки экономических, социальных, политических условий и последствий реализации

	экономических программ развития территории; – методы анализа и оценки внешней среды; – социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах	деятельности; - применять социальные и экономические методы и механизмы государственного и муниципального управления в различных сферах; - оценивать экономические, социальные, политические условия и последствия реализации государственных (муниципальных) программ	государственных (муниципальных) программ; - навыками оценки качества жизни населения как социально-экономической характеристики развития территории
Код компетенции	ПК-9		
	- эконометрические методы прогнозирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов на отраслевых, региональных уровнях; - методы стратегического анализа; - основы государственно-частного партнерства эконометрические методы прогнозирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - математические и статистические методы анализа социально-экономических процессов на	- рассчитывать индикаторы устойчивого развития территории; - осуществлять выбор оптимальных решений при разработке и реализации проектов, программ развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу; - разрабатывать программы развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу.	- методами прогнозирования и планирования развития рынка государственно-частного партнерства на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу.

	отраслевых, региональных уровнях; - методы стратегического анализа; - основы государственно-частного партнерства.		
--	---	--	--

3.2. Критерии оценки результатов обучения по дисциплине

Шкала оценивания	Индикаторы достижения	Показатели оценивания результатов обучения
ОТЛИЧНО	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	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.

		- связи теоретических положений с требованиями руководящих документов, - самостоятельного анализа факты, событий, явлений, процессов в их взаимосвязи и диалектическом развитии.
УДОВЛЕТВОРИТЕЛЬНО	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. - связи теоретических положений с требованиями руководящих документов, - самостоятельного анализа факты, событий, явлений, процессов в их взаимосвязи и диалектическом развитии.
Компетенция не достигнута		
НЕУДОВЛЕТВОРИТЕЛЬНО	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”.

4. Типовые контрольные задания и/или иные материалы для проведения промежуточной аттестации, необходимые для оценки достижения компетенции, соотнесенной с результатами обучения по дисциплине

Типовые контрольные задания для проверки знаний студентов

1. Риск – это:
 1. неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток
 2. все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка
 3. вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий
 4. вероятность провала программы продаж
2. Управление риском – это:

1. отказ от рискованного проекта
2. комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска
3. **комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него**
4. комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска

3. Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя:

1. выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска
2. прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска
3. **умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности**
4. умение ликвидировать такие последствия

4. Содержательная сторона риск-менеджмента включает в себя:

1. планирование деятельности по реализации рискованного проекта
2. **сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска**
3. выбор мер по минимизации или устранению последствий риска
4. организация службы управления рисками на предприятии

5. Что из перечисленного не является элементом системы риск-менеджмента?

1. выявление расхождений в альтернативах риска
2. разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий
3. учет психологического восприятия рискованных проектов
4. **все перечисленное является элементами системы риск-менеджмента**

6. Какие категории задач риск-менеджмента можно выделить?

1. применение риск-менеджмента
2. **применение методов риск-менеджмента**
3. управление рисками по их типам
4. точность оценок рисков

7. VAR – это:

1. **парадигма стоимости риска (Value-at-Risk)**
2. показатель объемов потерь прибыли (Volume at Reduce)
3. степень сопротивления персонала рискованным проектам (Volume at Resistance)
4. объем риска (Volume of Accepted Risk)

8. Главной функцией риск-менеджмента является:

1. создание чуткой системы управления рисками
2. оценка риска по каждому проекту в компании
3. **оценка риска для компании в целом**
4. предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий

9. Какие подходы выделяют при расчете VAR?

1. **эмпирический**
2. логический
3. оценочный
4. ранжирование

10. Что из перечисленного не является элементом расчета VAR для одного актива?

1. текущая стоимость актива
2. чувствительность стоимости к неблагоприятному изменению фактора риска
3. **изменение стоимости в перспективе**
4. возможное изменение фактора риска при данном доверительном уровне

11. Волатильность – это:

1. **изменчивость рыночного спроса**
2. постоянство рыночного спроса
3. изменчивость курсовых разниц и процентных ставок
4. постоянство курсовых разниц и процентных ставок

12. Суть риск-менеджмента состоит в:

1. устранении риска
2. **управлении риском**
3. снижении риска
4. выборе риска

13. Каковы функции объекта управления в риск-менеджменте?

1. организация разрешения риска
2. организация рискованных вложений капитала
3. организация работы по снижению величины риска
4. **все перечисленное является функциями объекта управления**

14. Что из перечисленного не является функциями субъекта управления в риск-менеджменте?

1. прогнозирование
2. **нормирование**
3. организация
4. регулирование

15. Что из перечисленного не является правилами риск-менеджмента?

1. нельзя рисковать многим ради малого
2. **риск – дело благородное**
3. нельзя думать, что существует только одно решение, возможно, есть и другие
4. при существовании нескольких вариантов, следует идти по пути минимально риска

ПК-7

1. Какие из перечисленных источников не могут использоваться для информационного обеспечения риск-менеджмента?

1. **имидж руководства организации**
2. кредитные договоры
3. тенденции развития рынков
4. бухгалтерская отчетность

2. Какие риски могут принести дополнительную прибыль фирме?

1. **спекулятивные**
2. чистые
3. ретроспективные
4. любые

3. Подразделение рисков на спекулятивные и чистые основано на:

1. классификации субъектов риска
2. классификации объектов риска
3. характере оценки риска
4. **характере последствий риска**

4. К типам рисков, не относящихся к критерию классификации "по сфере возникновения":

1. производственный риск
2. **кадровый риск**
3. финансовый риск
4. коммерческий риск

5. Коммерческий риск – это риск, возникающий:

1. на коммерческих предприятиях
2. при заключении коммерческих сделок
3. **в процессе реализации товаров или услуг**
4. в процессе производства товаров или услуг

6. На какие виды подразделяются финансовые риски?

1. **валютные**
2. денежные
3. проектные
4. риски распределения доходности

7. Валютный риск связан с:

1. покупкой и продажей валют
2. **любыми потерями, обусловленными изменением курса иностранной валюты**
3. обменом одной иностранной валюты на другую
4. ошибками при расчете кросс-курсов

8. Инфляционный риск - это:

1. риск увеличения темпов инфляции
2. **риск опережения роста доходов темпом их обесценивания**
3. риск инфляционных ожиданий
4. риск возникновения разницы в темпах инфляции на разных рынках сбыта

9. Системный риск - это:

1. **риск ухудшения конъюнктуры какого-либо рынка**
2. риск разрушения системы управления организацией
3. общая система рисков, которым подвергнута организация
4. система оценки и управления рисками

10. Деловой риск - это:

1. **риск неоплаты задолженности дебитором**
2. риск провала коммерческого проекта
3. риск разрушения деловых отношений
4. риск неисполнения обязательств по договору купли-продажи

11. Инновационный риск - это:

1. риск срыва сроков сдачи результатов научно-технических исследований
2. риск того, что новый товар не будет принят рынком

3. **риск того, что инновационный проект не будет реализован или окуплен**
4. риск, связанный с утечкой информации об используемых фирмой инновациях

12. Что их перечисленного не относится к видам производственных рисков?

1. изменение конъюнктуры рынка
2. усиление конкуренции
3. форс-мажор
4. **амортизация производственного оборудования**

13. При наличии неопределенностей процесс выбора оптимальных решений:

1. **усложняется**
2. упрощается
3. остается неизменным
4. нет зависимости

14. Какой прогнозируемостью характеризуется наступления события (P_t) при полной определенности?

1. 0,3
2. 0,7
3. **близкой к единице**
4. близкой к нулю

15. Близкая к единице прогнозируемость событий соответствует:

1. полной неопределенности
2. **полной определенности**
3. частичной неопределенности
4. нет правильного ответа

16. Неопределенность, связанную с отсутствием информации о вероятностях состоянии среды (природы), называют:

1. сомнительной
2. **безнадежной**
3. неопределенной
4. безвозвратной

17. Критерий гарантированного результата (максимальный критерий Вальда) является критерием:

1. наименьшего вреда
2. наибольшего вреда
3. оптимистическим
4. **пессимистическим**

18. Критерий пессимизма характеризуется выбором:

1. лучшей альтернативы с худшим из всех худших значений окупаемости
2. **худшей альтернативы с худшим из всех худших значений окупаемости**
3. худшей альтернативы с лучшим из всех худших значений окупаемости
4. лучшей альтернативы с лучшим из всех лучших значений окупаемости

19. Чем рискованнее проект, тем норма его доходности должна быть:

1. ниже
2. **выше**
3. норма доходности не зависит от риска

4. нет правильного ответа

20. Если событие не может произойти ни при каких условиях, его вероятность равна:

1. **нулю**
2. единице
3. 0,5
4. 100%

ПК-9

1. Какой метод оценки вероятностей используется в страховании?

1. система неопределенностей
2. **нормальное распределение**
3. пороговые значения риска
4. все перечисленные методы

2. В процессе принятия управленческих решений предпринимателю целесообразно различать и выделять определенные области (зоны риска) в зависимости от уровня возможных (ожидаемых) потерь. Для этого разработаны и используются:

1. изометрические шкалы
2. шкалы воздействия
3. **шкалы риска**
4. все ответы верны

3. Вторая точка вероятности нежелательного исхода, соответствует:

1. **«нормальному», «разумному» риску, при котором рекомендуется принимать обычные предпринимательские решения**
2. вероятности нежелательного исхода
3. потерям, равным имущественному состоянию предпринимателя
4. нет правильного ответа

4. Первая точка кривой рисков определяет:

1. величину потерь, равных расчетной выручке
2. **вероятность нулевых потерь**
3. вероятности нежелательного исхода
4. нет правильного ответа

5. Показатель допустимого риска не должен:

1. превышать предельного значения
2. **быть меньше предельной величины**
3. быть равным нулю
4. нет правильного ответа

6. Экспертный метод может быть реализован:

1. **путем обработки мнений опытных предпринимателей и специалистов**
2. с помощью опроса респондентов
3. путем не системной выборки
4. нет правильного ответа

7. Оценки экспертов должны удовлетворять следующему правилу:

1. **максимально допустимая разница между оценками двух экспертов по любому виду риска не должна превышать 50**

2. максимально допустимая разница между оценками двух экспертов по любому виду риска не должна превышать 25
3. максимально допустимая разница между оценками двух экспертов по любому виду риска не должна превышать 75
4. максимально допустимая разница между оценками двух экспертов по любому виду риска не должна превышать 5

8.Разновидностью экспертного метода является:

1. **метод Дельфи**
2. метод Гаусса
3. метод Иванова
4. все ответы верны

9.Методы управления рисками, предполагающие исключение рискованных ситуаций из бизнеса, носят название:

1. методы диссипации риска
2. методы компенсации риска
3. **методы уклонения от риска**
4. методы локализации риска

10.Методы управления рисками, основанные на четкой идентификации источников риска, носят название:

1. методы диссипации риска
2. методы компенсации риска
3. методы уклонения от риска
4. **методы локализации риска**

11.Методы управления рисками, относящиеся к упреждающим методам управления, носят название:

1. методы диссипации риска
2. **методы компенсации риска**
3. методы уклонения от риска
4. методы локализации риска

12.Методы управления рисками, связанные с распределением риска между стратегическими партнерами, носят название:

1. **методы диссипации риска**
2. методы компенсации риска
3. методы уклонения от риска
4. методы локализации риска

13.Интеграция, предполагающая объединение с поставщиками, – это:

1. **вертикальная регрессивная (обратная) интеграция**
2. вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция
3. горизонтальная интеграция
4. круговая интеграция

14.Интеграция, подразумевающая объединение с посредниками, образующими дистрибьюторскую сеть по сбыту продукции предприятия,- это:

1. вертикальная регрессивная (обратная) интеграция
2. **вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция**
3. горизонтальная интеграция

4. круговая интеграция

15. Финансирование под уступку денежного требования, подразумевающее передачу кредитного риска, это лежит в основе:

1. биржевых сделок
2. строительных контрактов
3. контракта – поручительства
4. **договора факторинга**

Типовые вопросы:

1. Сущность категории «риск».
2. Антикризисное управление: сущность, цели и задачи
3. Значение учета фактора риска в производственно-хозяйственной деятельности компании. Управление рисками.
4. Риск- менеджмент, его функции.
5. Стратегия управления рисками.
6. Чистые, спекулятивные, фундаментальные риски.
7. Политические риски, их виды.
8. Природно-естественные риски.
9. Классификация инновационных рисков.
10. Финансовые риски.
11. Кадровые риски.
12. Таможенные риски.
13. Моральный риск.
14. Криминальные риски, связанные с преступлениями в экономической сфере.
15. Чистые, спекулятивные, фундаментальные риски.
16. Политические риски, их виды.
17. Классификация инновационных рисков.
18. Производственно-технические риски.

Темы рефератов

1. Стандарты в области риск-менеджмента.
2. Служба управления рисками и ее место в организационной структуре организации.
3. Политика и программа по управлению рисками.
4. Подходы и принципы управления рисками на предприятии.
5. Принятие управленческих решений в условиях риска и неопределенности.
6. Экспертные методы анализа и оценки рисков.
7. Ранжирование как метод экспертной оценки рисков.
8. Основные способы воздействия на риски
9. Метод оценки риска по показателю Value-at-Risk
10. Финансовое состояние предприятия и риск банкротства.
11. Риск банкротства и методы прогнозирования банкротства.
12. Методы снижения рисков. Методы передачи рисков.
13. Методы удержания и компенсации рисков.
14. Сравнение методов управления рисками по эффективности. Метод Хаустона.
15. Критерии эффективности деятельности с учетом риска: EVA, RAROC
16. Принятие решений в условиях полной неопределенности с помощью матриц выигрышей (или матрицы рисков). Критерии Вальда, Сэвиджа, Гурвица.
17. Стратегические направления промышленной безопасности
18. Нормативное регулирование вопросов промышленной безопасности.

19. Информационная безопасность предприятия. Охрана служебной и коммерческой тайны.
20. Оценка рисков инвестиционных проектов: оценка чувствительности, сценарный анализ, метод Монте-Карло, построения дерева решений.

Типовые задания к интерактивным занятиям

Вопросы для подготовки к занятию №1

1. В чем заключается сущность риска?
2. Какие понятия риска, предлагаемые различными авторами, вы знаете?
3. В чем сходства этих понятий, а в чем различия?
4. Укажите основные моменты, характерные для рискованной ситуации.
5. Как вы считаете, для возникновения рискованной ситуации необходимо наличие всех перечисленных моментов?
6. Какие элементы отражают сущность риска?
7. Укажите основные черты риска. Охарактеризуйте их и приведите примеры.
8. Какие точки зрения на природу риска Вы знаете? Какая из точек зрения в настоящее время является преобладающей?

Вопросы для подготовки к занятию №2

1. Перечислите объекты исследования в теории рисков и безопасности. Как вы понимаете взаимосвязь между ними?
2. Какие объекты исследования в теории рисков и безопасности относятся к источникам опасности? Объектам рисков/безопасности? Субъектам обеспечения безопасности?
3. Какие существуют связи между источниками опасности и объектами безопасности? Приведите примеры.

Проблемно-аналитическое задание (кейс):

Описание проблемы: Крупный иностранный инвестор Джон Смит решил построить в одном российском городе гольф-клуб. Однако осуществить этот проект самостоятельно, без участия городских властей, было невозможно. Был заключен договор на создание гольфклуба. После долгих раздумий администрация выделила место – на помойке, больше свободной земли не было. Понятно, что нужно было проводить огромный комплекс работ, связанных с реинкарнацией почвы, поскольку земля была заражена отходами. Эксперты провели осмотр местности и составили смету, общая сумма составила \$2 млн. Инвестор заплатил эти деньги.

Мэрия города обратилась в организацию, которой поручила провести эти работы, при этом выделив на них из уплаченных \$2 млн только 5%. Остальные деньги остались в городской казне. Организация предупреждала, что на эти деньги можно навести только косметику на один год, а потом нужно будет постоянно обновлять поля, завозить газонную траву, так как земля будет быстро лысеть. Тем не менее, мэрия настояла на проведении работ в рамках выделенного бюджета, что и было сделано. Перед инвестором город отчитался, что все необходимые работы были проведены в полном объеме. А через год поля покрылись проплешинами и лысынами, их штопка обходится в крупную сумму. Поскольку поля плохого качества, то у клуба неважная репутация. Состоятельные клиенты обходят его стороной, они предпочитают ездить играть за границу. Клуб обанкротился.

Вопросы:

1. Что мог предпринять инвестор, чтобы не допустить подобного развития событий?
2. Мог ли он контролировать процесс?
3. Как можно было избежать банкротства? Какой компетенции ему не хватило?

Типовые вопросы к промежуточной аттестации:

1. Цели и задачи управления рисками.

2. Основные научные концепции риска
3. Основные принципы управления рисками.
4. Характеристика факторов риска внешней и внутренней среды организации.
5. Содержание риск-менеджмента на предприятии и этапы управления предпринимательскими рисками.
6. Стандарты в области риск-менеджмента.
7. Служба управления рисками и ее место в организационной структуре организации.
8. Политика и программа по управлению рисками.
9. Подходы и принципы управления рисками на предприятии.
10. Понятие и сущность риска. .
11. Классификация видов риска.
12. Принятие управленческих решений в условиях риска и неопределенности.
13. Финансовые риски.
14. Диагностика рисков на предприятии.
15. Характеристика процесса анализа рисков.
16. Качественный анализ и оценка рисков
17. Количественный анализ риска.
18. Статистические методы оценки риска.
19. Составление карт рисков как метод учета и анализа рисков
20. Экспертные методы анализа и оценки рисков.
21. Ранжирование как метод экспертной оценки рисков.
22. Основные способы воздействия на риски
23. Метод оценки риска по показателю Value-at-Risk
24. Финансовое состояние предприятия и риск банкротства.
25. Риск банкротства и методы прогнозирования банкротства.
26. Методы снижения рисков.
27. Методы передачи рисков.
28. Методы удержания и компенсации рисков.
29. Резервирование средств (понятие, область применения). Резервные фонды и их формы.
30. Лимитирование (понятие, область применения)
31. Диверсификация как метод управления рисками
32. Хеджирование как метод управления рисками.
33. Сравнение методов управления рисками по эффективности. Метод Хаустона.
34. Критерии эффективности деятельности с учетом риска: EVA, RAROC
35. Источники и факторы риска производственного предприятия
36. Оценка и анализ риска при осуществлении инвестиционной деятельности
37. Комплексная оценка рисков с помощью дерева вероятностей.
38. Принятие решений в условиях полной неопределенности с помощью матриц выигрышей (или матрицы рисков). Критерии Вальда, Сэвиджа, Гурвица.
39. Стратегические направления промышленной безопасности
40. Нормативное регулирование вопросов промышленной безопасности.
41. Информационная безопасность предприятия. Охрана служебной и коммерческой тайны.
42. Требования к организационным и техническим мерам защиты охраняемых законом тайн.
43. Характеристика менеджмента рисков промышленного предприятия. Ситуационные планы
44. Методы учета и оценки рисков инвестиционных проектов
45. Оценка рисков инвестиционных проектов: оценка чувствительности, сценарный анализ, метод Монте-Карло, построения дерева решений.

5. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания индикаторов достижения компетенций

Специфика формирования компетенций и их измерение определяется

структурированием информации о состоянии уровня подготовки обучающихся.

Алгоритмы отбора и конструирования заданий для оценки достижений в предметной области, техника конструирования заданий, способы организации и проведения стандартизированных оценочных процедур, методика шкалирования и методы обработки и интерпретации результатов оценивания позволяют обучающимся освоить компетентностно-ориентированные программы дисциплин.

Формирование компетенций осуществляется в ходе всех видов занятий, практики, а контроль их сформированности на этапе текущей, промежуточной и итоговой аттестации.

Оценивание знаний, умений и навыков по учебной дисциплине осуществляется посредством использования следующих видов оценочных средств:

- опросы: устный, письменный;
- задания для практических занятий;
- ситуационные задания;
- контрольные работы;
- коллоквиумы;
- написание реферата;
- написание эссе;
- решение тестовых заданий;
- экзамен.

Опросы по вынесенным на обсуждение темам

Устные опросы проводятся во время практических занятий и возможны при проведении аттестации в качестве дополнительного испытания при недостаточности результатов тестирования и решения заданий. Вопросы опроса не должны выходить за рамки объявленной для данного занятия темы. Устные опросы необходимо строить так, чтобы вовлечь в тему обсуждения максимальное количество обучающихся в группе, проводить параллели с уже пройденным учебным материалом данной дисциплины и смежными курсами, находить удачные примеры из современной действительности, что увеличивает эффективность усвоения материала на ассоциациях.

Основные вопросы для устного опроса доводятся до сведения студентов на предыдущем практическом занятии.

Письменные опросы позволяют проверить уровень подготовки к практическому занятию всех обучающихся в группе, при этом оставляя достаточно учебного времени для иных форм педагогической деятельности в рамках данного занятия. Письменный опрос проводится без предупреждения, что стимулирует обучающихся к систематической подготовке к занятиям. Вопросы для опроса готовятся заранее, формулируются узко, дабы обучающийся имел объективную возможность полноценно его осветить за отведенное время.

Письменные опросы целесообразно применять в целях проверки усвояемости значительного объема учебного материала, например, во время проведения аттестации, когда необходимо проверить знания обучающихся по всему курсу.

При оценке опросов анализу подлежит точность формулировок, связность изложения материала, обоснованность суждений.

Решение заданий (кейс-методы)

Решение кейс-методов осуществляется с целью проверки уровня навыков (владений) обучающегося по применению содержания основных понятий и терминов дисциплины вообще и каждой её темы в частности.

Обучающемуся объявляется условие задания, решение которого он излагает либо устно, либо письменно.

Эффективным интерактивным способом решения задания является сопоставления результатов разрешения одного задания двумя и более малыми группами обучающихся.

Задачи, требующие изучения значительного объема, необходимо относить на

самостоятельную работу студентов, с непременным разбором результатов во время практических занятий. В данном случае решение ситуационных задач с глубоким обоснованием должно представляться на проверку в письменном виде.

При оценке решения заданий анализируется понимание обучающимся конкретной ситуации, правильность её понимания в соответствии с изучаемым материалом, способность обоснования выбранной точки зрения, глубина проработки рассматриваемого вопроса, умением выявить основные положения затронутого вопроса.

Решение заданий в тестовой форме

Проводится тестирование в течение изучения дисциплины

Не менее чем за 1 неделю до тестирования, преподаватель должен определить обучающимся исходные данные для подготовки к тестированию: назвать разделы (темы, вопросы), по которым будут задания в тестовой форме, теоретические источники (с точным указанием разделов, тем, статей) для подготовки.

При прохождении тестирования пользоваться конспектами лекций, учебниками, и иными материалами не разрешено.