

**Федеральное государственное бюджетное образовательное  
учреждение высшего образования  
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА  
И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ  
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

**ИНСТИТУТ ОТРАСЛЕВОГО МЕНЕДЖМЕНТА**

**Факультет инженерного менеджмента**

**Кафедра теории и систем отраслевого управления**

УТВЕРЖДЕНА  
кафедрой теории и систем  
отраслевого управления  
Протокол от «28» августа 2017 г.  
№ 1

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**Б1.В.ДВ.01.01 РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ**

направление подготовки

**38.04.02 Менеджмент**

направленность (профиль):

**«Управление производственными системами»**

квалификация (степень) выпускника

**магистр**

форма обучения

**очная**

Год набора - 2018

Москва, 2017 г.

Автор–составитель:

д.э.н. профессор, профессор кафедры теории и систем отраслевого управления  
Минченкова О.Ю.

старший преподаватель кафедры теории и систем отраслевого управления Бородулин А.Л.

Заведующий кафедрой теории и систем отраслевого управления к.э.н., доцент  
Серебренников С.С.

## СОДЕРЖАНИЕ

<b>1. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ .....</b>	<b>4</b>
<b>2. ОБЪЕМ И МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ.....</b>	<b>5</b>
<b>3. СОДЕРЖАНИЕ И СТРУКТУРА.....</b>	<b>5</b>
<b>4. МАТЕРИАЛЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ ОБУЧАЮЩИХСЯ И ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ.....</b>	<b>7</b>
4.1. ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ .....	7
4.01.01. <i>Формы текущего контроля успеваемости.....</i>	<i>7</i>
4.1.2. <i>Материалы текущего контроля успеваемости.....</i>	<i>7</i>
4.2. ПРОМЕЖУТОЧНАЯ АТТЕСТАЦИЯ .....	10
4.2.1. <i>Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы. Показатели и критерии оценивания компетенций с учетом этапа их формирования.....</i>	<i>10</i>
4.2.2. <i>Форма и средства проведения промежуточной аттестации.....</i>	<i>11</i>
4.2.3. <i>Типовые оценочные средства .....</i>	<i>11</i>
4.3. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ .....	13
<b>5. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ .....</b>	<b>16</b>
<b>6. УЧЕБНАЯ ЛИТЕРАТУРА И РЕСУРСЫ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ "ИНТЕРНЕТ", УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ.....</b>	<b>18</b>
6.1. ОСНОВНАЯ ЛИТЕРАТУРА .....	18
6.2. ДОПОЛНИТЕЛЬНАЯ ЛИТЕРАТУРА.....	18
6.3. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ .....	18
6.4. НОРМАТИВНЫЕ ПРАВОВЫЕ ДОКУМЕНТЫ .....	18
6.5. ИНТЕРНЕТ-РЕСУРСЫ .....	18
<b>7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКАЯ БАЗА, ИНФОРМАЦИОННЫЕ ТЕХНОЛОГИИ, ПРОГРАММНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ И ИНФОРМАЦИОННЫЕ СПРАВОЧНЫЕ СИСТЕМЫ.....</b>	<b>19</b>

# 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

1.1. Дисциплина Б1.В.ДВ.01.01 «Риск-менеджмент» обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ДПК	Способность управлять процессами планирования и организации производства в условиях нестабильности и турбулентности политической и экономической среды	ДПК-2.1	Способность оценивать риски и определять необходимые меры по минимизации негативного воздействия турбулентности политической и экономической среды

1.2. В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

Обобщенные трудовые функции и трудовые функции	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
<b>Профессиональный стандарт:</b> Специалист по автоматизированным системам управления производством <b>Обобщенная трудовая функция:</b> Г. Организация проведения работ по проектированию АСУП <b>Трудовые функции:</b> Г/01.7 Организация разработки мероприятий по повышению качества функционирования АСУП (или ее элементов) Г/03.7 Организация анализа и оптимизации процессов управления жизненным циклом АСУП в организации	ДПК.2-1	<u>на уровне знаний:</u> <ul style="list-style-type: none"> <li>• демонстрирует знание основных понятий и категорий риск-менеджмента</li> <li>• перечисляет все функции управления рисками предприятия</li> <li>• классифицирует рисковые события</li> </ul>
		<u>на уровне умений:</u> <ul style="list-style-type: none"> <li>• анализирует и оценивает по известным критериям возможные сценарии развития предприятия</li> <li>• аргументирует выбор сценария развития бизнес направления с учетом рыночной конъюнктуры</li> <li>• выбирает метод управления риском, подходящий для анализируемой бизнес-ситуации</li> <li>• анализирует условия развития предприятия и выявлены возможные риски</li> <li>• составляет карту рисков проекта</li> <li>• указывает и аргументирует причины для разработки стандартов и фреймворков по управлению рисками</li> </ul>
		<u>на уровне навыков:</u> <ul style="list-style-type: none"> <li>• рассчитывает VaR для проекта по заданным условиям</li> </ul>

## 2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы

### Место дисциплины

Дисциплина Б1.В.ДВ.01.01 «Риск-менеджмент» относится к дисциплинам по выбору вариативной части образовательной программы подготовки магистров по направлению 38.04.02 «Менеджмент» направленности «Управление производственными системами» и изучается в 1 семестре.

### Объем дисциплины

Трудоемкость дисциплины оценивается в 3 ЗЕТ (108 академических часов/81 астрономических часов). На контактную работу с преподавателем в форме лекционных занятий отводится (8 академических часов/6 астрономических часов), в форме практических занятий – (20 академических часов/ 15 астрономических часов). На самостоятельную работу обучающихся отводится (80 академических часов/ 60 астрономических часов).

## 3. Содержание и структура

№	Наименование тем и/или разделов	Объем дисциплины(модуля), час						Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации
		всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л	ЛР	ПЗ	КСР		
Тема 1	Риск и неопределенность бизнес-среды	24/ 18	2/ 1,5		2/ 1,5	4/ 3	20/ 15	Т№1
Тема 2	Принятие решений в условиях риска	14/ 10,5	2/ 1,5		4/ 3	6/ 4,5	10/ 7,5	ПКР
Тема 3	Риск-менеджмент: роль и место в общей системе менеджмента	16/ 12	2/ 1,5		4/ 3	6/ 4,5	20/ 15	Э №1
Тема 4	Методы анализа и оценки рисков	24/ 18	2/ 1,5		4/ 3	6/ 4,5	10/ 7,5	ГТЗ
Тема 5	Методы управления рисками	14/ 10,5			2/ 1,5	4/ 3	10/ 7,5	КТ
Тема 6	Построение системы риск-менеджмента	16/ 12			4/ 3	6/ 4,5	10/ 7,5	Э №2
Промежуточная аттестация		зачет с оценкой						
Всего:		108/ 81	8/ 6		20/ 15	28 /21	80/ 60	

Условные обозначения: тестирование (Т), письменное контрольное задание (ПКР), эссе (Э), групповое творческое задание (ГТЗ), кейс-тестирование(КТ), зачет с оценкой (ЗаО)

### Содержание дисциплины

#### Тема 1. Риск и неопределенность бизнес-среды.

Понятие и сущность рисков. Понятие риска в научном и прикладном значениях.. Неопределенность и источники риска. Структурная характеристика риска. Психологические аспекты риска. Подходы к классификации рисков. Общие принципы классификации рисков.

#### Тема 2. Принятие решений в условиях риска

Принятие решений в условиях неопределенности. Критерий Лапласа, критерий Сэвиджа, критерий Гурвица, минимаксный критерий. Принятие решений в условиях риска. Критерий ожидаемого значения (прибыли или расходов); комбинация ожидаемого значения и дисперсии, критерий предельного уровня; критерий наиболее вероятного

исхода. Экспериментальные данные при принятии решений в условиях риска. Деревья решений.

### **Тема 3. Риск-менеджмент: роль и место в общей системе менеджмента**

Необходимость выявления, анализа и управления рисками предприятия. Понятие и значение интегрированного риска предприятия. Содержание риск-менеджмента в организации. Роль риск-менеджмента в общей системе менеджмента организации. Риски как факторы возникновения кризисных явлений в организации. Организационно-экономические и правовые аспекты возникновения рисков в организациях, и их последствия. Основные задачи риск-менеджмента.

### **Тема 4. Методы анализа и оценки рисков.**

Качественные методы анализа и оценки рисков. Эволюция теории риска. Основные компоненты методологии риск-менеджмента. Методы анализа и измерения риска в стандартах ISO 31000 и 31010. Экспертные методы анализа рисков. Применение теории игр для оценки рисков.

Статистические показатели риска. Распределение факторов риска. Правило трех сигм. Риск и доходность. Принципы диверсификации. Портфельная теория Марковица. Модель CAPM. Стоимостная оценка риска. VaR-методология

### **Тема 5. Методы управления рисками**

Общие принципы управления риском. Схема процесса управления риском. Выбор приемов управления риском. Диверсификация. Страхование риска. Хеджирование. Лимитирование. Резервирование средств(самострахование). Качественное управление рисками.

### **Тема 6. Построение системы риск-менеджмента**

Стратегический анализ деятельности корпорации в целях выработки направлений менеджмента рисков. Особенности жизненного цикла и измерение рискового спектра корпорации в условиях неопределенности. Организационная структура корпоративного риск-менеджмента. Интегрирование элементов риск-менеджмента в бизнес-процессы компании.

Финансирование риска и анализ эффективности риск-менеджмента. Современные методы диагностики рисков корпоративных организаций. Финансирование программы управления рисками.

#### 4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине

##### 4.1. Текущий контроль успеваемости

##### 4.01.01. Формы текущего контроля успеваемости

В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.01.01 «Риск-менеджмент» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

№	Наименование тем и/или разделов	Методы текущего контроля успеваемости
Тема 1	Риск и неопределенность бизнес-среды	Т№1
Тема 2	Принятие решений в условиях риска	ПКР
Тема 3	Риск-менеджмент: роль и место в общей системе менеджмента	Э №1
Тема 4	Методы анализа и оценки рисков	ГТЗ
Тема 5	Методы управления рисками	КТ
Тема 6	Построение системы риск-менеджмента	Э №2

##### 4.1.2. Материалы текущего контроля успеваемости

##### Типовые задания по теме 1

Текущий контроль по теме 1 проводится в форме тестирования. Каждый вариант теста состоит из 20 вопросов, содержащих по 4 варианта ответа. Студенту следует выбрать не более 1 правильного ответа.

На выполнение теста обучающимся отводится 40 мин.

##### Контент теста:

Риск – это:

- А. потенциальная возможность наступления совокупности событий;
- В. вероятность возникновения потерь или выигрыша за определенное время при реализации одного из вариантов, выбранных в процессе деятельности;
- С. неопределенность в отношении возможных потерь на пути к цели;
- Д. все варианты не верны.

Что из перечисленного может быть источником риска?

- А. случайные явления природы;
- В. ненадежность технических элементов,
- С. неверные решения и запаздывание решений, а также другие ошибки менеджмента;
- Д. все вышеперечисленное.

Рискованной экономической ситуации сопутствуют следующие взаимосвязанные условия (выделить лишнее):

- А. наличие неопределенности;
- В. необходимость выбора альтернативы;
- С. наличие исходной директивы (в отношении определения целей);
- Д. возможность качественной и количественной оценки вероятности осуществления того или иного варианта.

Главной функцией риск-менеджмента является:

- А. создание системы управления финансовыми рисками;
- В. оценка риска по каждому проекту в компании;
- С. предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий;
- Д. оценка риска для компании в целом.

Принятие стандартов риск-менеджмента необходимо для достижения согласия по нескольким вопросам, а именно:

- А. процесс практического применения риск-менеджмента;
- В. организационная структура риск-менеджмента;

- С. цель риск-менеджмента;
- Д. все вышеперечисленное.

### Типовые задания по теме 2.

Текущий контроль по теме 2 проводится в форме письменной контрольной работы, подразумевающей решение задачи и ответ на 2 теоретических вопроса. Работа проводится в аудитории под контролем преподавателя. На выполнение работы студентам отводится 60 мин.

Примерный вариант письменной контрольной работы

#### Вопросы:

1. В чем особенность принятия управленческого решения в условиях риска и неопределенности?
2. В чем заключается критерий Лапласа?

#### Задание 1.

Производственное предприятие готовится к переходу на новые виды продукции, при этом возможны четыре решения  $P_1, P_2, P_3, P_4$ , каждому из которых соответствует определенный вид выпуска или их сочетание. Результаты принятия решений существенно зависят от обстановки, которая в значительной степени неопределена. Варианты обстановки характеризует структура спроса на новую продукцию, которая может быть трех типов:  $\Pi_1, \Pi_2, \Pi_3$ . Выигрыш, характеризующий относительную величину результата (доходы, прибыль и т.п.), соответствующий каждой паре сочетаний решений  $P$  и обстановки  $\Pi$ , представлен в таблице

Виды решений	Тип структуры спроса		
	$\Pi_1$	$\Pi_2$	$\Pi_3$
$P_1$	0,4	0,34	0,3
$P_2$	0,7	0,15	0,2
$P_3$	0,4	0,7	0,05
$P_4$	0,1	0,1	0,2

Определите оптимальную стратегию с помощью критерия Гурвица.

### Типовые задания по теме 3.

Текущий контроль по теме 3 осуществляется в форме эссе. Данная работа выполняется студентом самостоятельно при консультационной поддержке преподавателя. На выполнение работы студенту отводится две недели. Рекомендуемый объем эссе: 1500 знаков.

Темы эссе

1. Роль риск-менеджмента в общей системе менеджмента организации.
2. Риски как факторы возникновения кризисных явлений в организации.

### Типовые задания по теме 4

Текущий контроль по теме 4 проводится в форме группового творческого задания. Для выполнения задания студенты делятся на группы по 2-3 человека.

Примерный вариант задания

Вы планируете открытие цветочного магазина. Приведите по 2 примера рисков, с которыми вы можете столкнуться:

Рыночный риск:

- 1) \_\_\_\_\_
- 2) \_\_\_\_\_

Кредитный риск

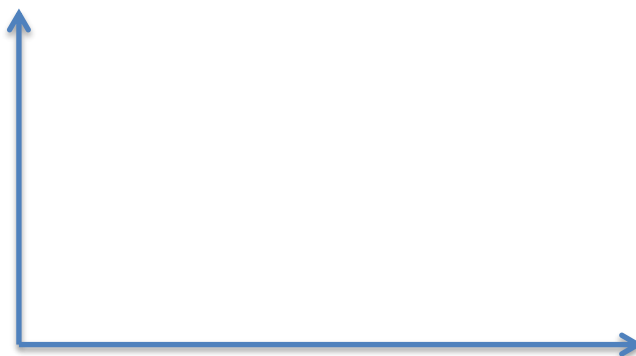
- 3) \_\_\_\_\_
- 4) \_\_\_\_\_

Операционный риск



- 5) \_\_\_\_\_  
6) \_\_\_\_\_  
Риск ликвидности  
7) \_\_\_\_\_  
8) \_\_\_\_\_

Расположите рисковые события на карте рисков, предварительно подписав оси:



### Типовые задания по теме 5

Текущий контроль по теме 5 проводится в форме кейс-тестирования. Студенту следует ознакомиться с текстом мини-кейса и выбрать одно из предлагаемых решений как наиболее правильное.

#### Контент кейс-тестирования

1. Основатель интернет-магазина Proskater.ru, продающего спортивную одежду и обувь, сноуборды и скейты Павел Жданкин в интервью portalu vs.ru рассказал, что главные проблемы неликвидного товара в том, что он занимает место на складе, что не позволяет компании своевременно закупать более интересные клиентам продукты. В прошлом году Proskater.ru внедрил новую систему анализа запросов на сайте и автоматической установки бонусов - цель выровнять вероятность покупки товара за счёт скидок и подарков к покупке. Данный пример подтверждает, что в процессе выработки решения по управлению риском, компании иногда приходят к необходимости:

- A. Принятия риска
- B. Лимитирования риска
- C. Страхования риска
- D. Хеджирования риска

2. Клиринговая компания выявила и оценила риск недоступности своих информационных систем в течение более чем трех часов и пришла к выводу, что она не может допустить такого события. Компания вложила средства в разработку технологического решения по улучшению систем самодиагностики и резервного копирования для снижения вероятности возникновения недоступности систем. Какой способ реагирования на риск использовала компания?

- A. принятие риска
- B. уклонение от риска
- C. сокращение риска
- D. перераспределение риска

3. В процессе анализа проекта была выявлена невозможность подключения дополнительных объектов к сетям энергоснабжения. Компания приняла решение отказаться от реализации данного проекта. О каком методе управления рисками идет речь?

- A. принятие риска
- B. передача риска
- C. сокращение риска

Д. отказ от риска

4. ОАО «Ростелеком» был генеральным партнером XXII Зимних Олимпийских Игр и XI Зимних Паралимпийских Игр Сочи-2014. Общий объем трафика, прошедший по олимпийским каналам связи «Ростелекома» общей протяженностью более 1000 км, превысил рекордный 1 Петабайт(более 1000 Тб или 1 млн Гб). Разумеется, это было результатом серьезной работы и потребовало от «Ростелекома» разработки системы определения условий сотрудничества на основании результатов мониторинга показателей риска контрагентов и заключения договоров строго на определенные объемы работ

А. сокращение риска

В. принятие риска

С. передача риска

#### Типовые задания по теме 6.

Текущий контроль по теме 6 осуществляется в форме эссе. Данная работа выполняется студентом самостоятельно при консультационной поддержке преподавателя. На выполнение работы студенту отводится две недели. Рекомендуемый объем эссе: 1500 знаков.

#### Темы эссе

1. Оценка эффективности системы риск-менеджмента
2. Внедрение системы интегрированного риск-менеджмента для повышения стоимости бизнеса.

### 4.2. Промежуточная аттестация

#### 4.2.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы. Показатели и критерии оценивания компетенций с учетом этапа их формирования

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ДПК-2	Способность управлять процессами планирования и организации производства в условиях нестабильности и турбулентности политической и экономической среды	ДПК-2.1	Способность оценивать риски и определять необходимые меры по минимизации негативного воздействия турбулентности политической и экономической среды

Этап освоения компетенции	Показатель оценивания	Критерий оценивания
ДПК-2.1 Способность оценивать риски и определять необходимые меры по минимизации негативного воздействия турбулентности	<ul style="list-style-type: none"><li>оценивает влияние неопределенности и риска на результаты деятельности</li><li>выбирает метод управления риском, подходящий для анализируемой бизнес-ситуации</li></ul>	<ul style="list-style-type: none"><li>на профессиональном уровне с использование современного инструментария риск-менеджмента проведена оценка влияния неопределенности и риска на результаты деятельности</li><li>грамотно выбран метод управления риском,</li></ul>

политической и экономической среды	<ul style="list-style-type: none"> <li>• выявляет оптимизационные задачи реального мира и строит их математическую модель</li> <li>• выбирает метод решения задачи оптимизации, подходящий для рассматриваемой модели</li> <li>• выбирает оптимальную стратегию с учетом неопределённости и риска</li> </ul>	<p>подходящий для анализируемой бизнес-ситуации</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• выявлена и на основе имеющихся знаний о различных методах построения экономико-математических моделей грамотно поставлена в формальном виде оптимизационная задача реального мира</li> <li>• выбран метод решения задачи оптимизации, наиболее подходящий для рассматриваемой модели</li> <li>• выбрана оптимальная стратегия с учетом неопределённости и риска</li> </ul>
------------------------------------	--	---

#### 4.2.2. Форма и средства проведения промежуточной аттестации

По дисциплине Б1.В.ДВ.01.01 «Риск-менеджмент» учебный планом предусмотрен зачет с оценкой, который проводится в письменной форме.

#### 4.2.3. Типовые оценочные средства

Типовой варианты билета

##### Билет №1

1. Определите однодневный VaR с доверительной вероятностью 90% для портфеля для одного актива стоимостью 20 млн. руб. при условии, что стандартное отклонение доходности актива за один день составляет 3%?

2. Производственное предприятие готовится к переходу на новые виды продукции, при этом возможны четыре решения P1, P2, P3, P4, каждому из которых соответствует определенный вид выпуска или их сочетание. Результаты принятия решений существенно зависят от обстановки, которая в значительной степени неопределена. Варианты обстановки характеризует структура спроса на новую продукцию, которая может быть трех типов: П1, П2, П3. Выигрыш, характеризующий относительную величину результата (доходы, прибыль и т.п.), соответствующий каждой паре сочетаний решений P и обстановки П, представлен в таблице

Виды решений	Тип структуры спроса		
	П1	П2	П3
P1	0,1	0,25	0,3
P2	0,6	0,15	0,2
P3	0,4	0,7	0,05
P4	0,8	0,1	0,2

Определите оптимальную стратегию с помощью критерия Вальда.

3. Компания, компьютерный центр которой расположен в регионе, подверженном частым штормам, принимает решение о страховании риска повреждения зданий, хотя это и не оказывает влияния на вероятность шторма. Какой способ реагирования на риск выбирает компания?

##### Билет №2

1. Определите однодневный VaR с доверительной вероятностью 95% для портфеля для одного актива стоимостью 17 млн. руб. при условии, что стандартное отклонение доходности актива за один день составляет 3%?

2. Производственное предприятие готовится к переходу на новые виды продукции,

при этом возможны четыре решения P1, P2, P3, P4, каждому из которых соответствует определенный вид выпуска или их сочетание. Результаты принятия решений существенно зависят от обстановки, которая в значительной степени неопределена. Варианты обстановки характеризует структура спроса на новую продукцию, которая может быть трех типов: П1, П2, П3. Выигрыш, характеризующий относительную величину результата (доходы, прибыль и т.п.), соответствующий каждой паре сочетаний решений Р и обстановки П, представлен в таблице

Виды решений	Тип структуры спроса		
	П1	П2	П3
P1	0,1	0,25	0,3
P2	0,6	0,15	0,2
P3	0,4	0,7	0,05
P4	0,8	0,1	0,2

Определите оптимальную стратегию с помощью критерия максимакса.

3. На стадии заключения контракта на строительство опытного участка Заказчик и Исполнитель оговаривают фиксированную стоимость контракта на проведение работ. В дальнейшем в случае повышения стоимости строительных материалов и комплектующих Исполнитель покрывает данные изменения из собственной прибыли. Какую стратегию управления рисками использует Заказчик?

### 4.3. Методические материалы

#### Методические материалы к контролю по теме №1

Формой текущего контроля успеваемости по теме 1 является тестирование. Каждый вариант теста состоит из 6 вопросов. Каждый из вопросов предполагает 4 варианта ответа. Студенту следует выбрать 1 правильный вариант ответа, из предложенных тестом, или указать на его отсутствие, аргументировав свою точку зрения.

Шкала оценивания для текущей аттестации по теме 1

Оценка	Требования к знаниям
«зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется, если студентом даны верные ответы на 70% и более вопросов
«не зачтено»	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, если студентом даны верные ответы менее, чем на 70% вопросов

#### Методические материалы к контролю по теме №2

Текущий контроль по теме 2 проводится в форме письменной контрольной работы, подразумевающей решение задачи и ответ на 2 теоретических вопроса. Работа проводится в аудитории под контролем преподавателя. На выполнение работы студентам отводится 60 мин.

Шкала оценивания для текущей аттестации по теме 2:

Оценка	Требования к знаниям
«зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется, если студентом: 1. дан правильный ответ на вопрос с использованием профессиональной лексики и терминологии 2. приведено корректное решение задач 3. даны верные ответы на 50% и более задач
«не зачтено»	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, если студентом: 1. дан правильный ответ на вопрос, но профессиональная лексика и терминология не используется 2. даны верные ответы менее, чем на 50% задач

#### Методические материалы к контролю по теме №3.

Текущий контроль по теме 3 осуществляется в форме эссе. Данная работа выполняется студентом самостоятельно при консультационной поддержке преподавателя. На выполнение работы студенту отводится две недели. Рекомендуемый объем эссе: 1500 знаков.

Шкала оценивания для текущей аттестации по теме 3

Оценка	Требования к знаниям
«зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется, если студентом: 1. четко высказана собственная позиция на данный вопрос 2. приведены доводы, четко связанные друг с другом и расположенные в логическом порядке 3. использованы исследования других людей для поддержания доказательства и усиления аргументации 4. сделана обоснованная оценка взглядов других людей, особенно противоречащих его собственным

«не зачтено»	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, если студентом <ol style="list-style-type: none"> <li>1. не высказано собственная позиция на данный вопрос</li> <li>2. приведены доводы, четко не связанные друг с другом</li> <li>3. не использованы исследования других людей для поддержания доказательства и усиления аргументации</li> <li>4. не сделана обоснованная оценка взглядов других людей, особенно противоречащих его собственным</li> </ol>
--------------	--

#### Методические материалы к контролю по теме №4

Текущий контроль по теме 4 проводится в форме группового творческого задания. Для выполнения задания студенты делятся на группы по 2-3 человека.

Шкала оценивания для текущей аттестации по теме 4:

Оценка	Требования к знаниям
«зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется, если студентом: <ol style="list-style-type: none"> <li>1. верно классифицированы рисковые события</li> <li>2. рисковые события грамотно размещены на карте рисков</li> </ol>
«не зачтено»	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, если студентом: <ol style="list-style-type: none"> <li>1. не верно классифицированы рисковые события</li> <li>2. рисковые события не корректно размещены на карте рисков</li> </ol>

#### Методические материалы к контролю по теме №5

Текущий контроль по теме 5 проводится в форме кейс-тестирования. Студенту следует ознакомиться с текстом мини-кейса и выбрать одно из предлагаемых решений как наиболее правильное

Шкала оценивания для текущей аттестации по теме 5:

Оценка	Требования к знаниям
«зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется, если студентом даны верные ответы на 70% и более вопросов
«не зачтено»	Оценка «не зачтено» выставляется студенту, если студентом даны верные ответы менее, чем на 70% вопросов

#### Методические материалы к контролю по теме №6

Текущий контроль по теме 6 осуществляется в форме эссе. Данная работа выполняется студентом самостоятельно при консультационной поддержке преподавателя. На выполнение работы студенту отводится две недели. Рекомендуемый объем эссе: 1500 знаков

Шкала оценивания для текущей аттестации по теме 6

Оценка	Требования к знаниям
«зачтено»	Оценка «зачтено» выставляется, если студентом: <ol style="list-style-type: none"> <li>1. четко высказана собственная позиция на данный вопрос</li> <li>2. приведены доводы, четко связанные друг с другом и расположенные в логическом порядке</li> <li>3. использованы исследования других людей для поддержания доказательства и усиления аргументации</li> <li>4. сделана обоснованная оценка взглядов других людей, особенно противоречащих его собственным</li> </ol>

«не зачтено»	<p>Оценка «не зачтено» выставляется студенту, если студентом</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. не высказано собственная позиция на данный вопрос</li> <li>2. приведены доводы, четко не связанные друг с другом</li> <li>3. не использованы исследования других людей для поддержания доказательства и усиления аргументации</li> <li>4. не сделана обоснованная оценка взглядов других людей, особенно противоречащих его собственным</li> </ol>
--------------	---

### Методические материалы к промежуточной аттестации

Б1.В.ДВ.01.01 «Риск-менеджмент» учебный планом предусмотрен зачет с оценкой который проводится в письменной форме.

#### Шкала оценивания для промежуточной аттестации:

Оценка	Требования к знаниям
5, «отлично»	<p>Оценка «отлично» выставляется, если студентом:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. на профессиональном уровне с использование современного инструментария риск-менеджмента проведена оценка влияния неопределенности и риска на результаты деятельности</li> <li>2. грамотно выбран метод управления риском, подходящий для анализируемой бизнес-ситуации</li> <li>3. выбрана оптимальная стратегия с учетом неопределённости и риска</li> </ol>
4, «хорошо»	<p>Оценка «хорошо» выставляется, если студентом:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. проведена оценка влияния неопределенности и риска на результаты деятельности</li> <li>2. грамотно выбран метод управления риском, подходящий для анализируемой бизнес-ситуации</li> <li>3. выбрана не оптимальная стратегия с учетом неопределённости и риска</li> </ol>
3, «удовлетворительно»	<p>Оценка «удовлетворительно» выставляется, если студентом:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. на удовлетворительном уровне проведена оценка влияния неопределенности и риска на результаты деятельности</li> <li>2. выбран метод управления риском, подходящий для анализируемой бизнес-ситуации</li> <li>3. выбрана не оптимальная стратегия с учетом неопределённости и риска</li> </ol>
2, «неудовлетворительно»	<p>Оценка «неудовлетворительно» выставляется, если студентом:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. не проведена оценка влияния неопределенности и риска на результаты деятельности</li> <li>2. выбран метод управления риском, не подходящий для анализируемой бизнес-ситуации</li> <li>3. выбрана не оптимальная стратегия с учетом неопределённости и риска</li> </ol>

## **5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины**

Процесс обучения по дисциплине Б1.В.ДВ.01.01 «Риск-менеджмент» включает следующие основные виды занятий:

- лекции;
- практические занятия;
- самостоятельная работа.

На лекциях студенты изучают основные теоретические концепции риск-менеджмента, основы регулирования и стандартизации в сфере управления рисками, знакомятся с наиболее известными работами ученых и существующими практическими разработками в данной области, закрепляя полученные знания на практических занятиях. С целью обеспечения успешного обучения студенту необходимо готовиться к каждой лекции, т.к. она является важнейшей формой организации учебного процесса, поскольку знакомит с новым учебным материалом, разъясняет учебные элементы, трудные для понимания, систематизирует учебный материал, ориентирует в учебном процессе.

Подготовку к лекции рекомендуется проводить по следующему плану:

1. внимательно прочитайте материал предыдущей лекции;
2. узнайте тему предстоящей лекции (по тематическому плану, по информации лектора);
3. ознакомьтесь с учебным материалом по учебнику и учебным пособиям;
4. постарайтесь уяснить место изучаемой темы в своей профессиональной подготовке;
5. запишите возможные вопросы, которые вы зададите лектору на лекции

Практические занятия предполагают выполнение различного вида работ: разбор типовых ситуаций, анализ кейсов, дискуссии, деловые игры. Практические работы выполняются на базе технических средств университета и программного обеспечения университетского фонда.

Подготовку к практическому занятию рекомендуется проводить по следующему плану:

1. внимательно прочитайте материал лекций относящихся к данному семинарскому занятию, ознакомьтесь с учебным материалом по учебнику и учебным пособиям;
2. выпишите основные термины;
3. ответьте на контрольные вопросы по семинарским занятиям, готовьтесь дать развернутый ответ на каждый из вопросов;
4. уясните, какие учебные элементы остались для вас неясными и постарайтесь получить на них ответ заранее (до семинарского занятия) во время текущих консультаций преподавателя;
5. готовиться можно индивидуально, парами или в составе малой группы, последние являются эффективными формами работы;

Получение углубленных знаний по изучаемой дисциплине достигается за счет дополнения часов аудиторной нагрузки самостоятельной работой студентов, которая выражается в анализе дополнительной литературы по учебной дисциплине и подготовке реферативных материалов по отдельным темам учебной программы. При изучении дисциплины предусматривается обеспечение гармоничной взаимосвязи между аудиторной и самостоятельной работой студентов, для чего в рамках курса предлагается набор активных и интерактивных методов занятий в развитие сюжетов, рассмотренных в рамках лекций и практических занятий.

### **Подготовка к промежуточной аттестации:**

На первом занятии преподаватель информирует обучающихся о применяемой системе текущего контроля успеваемости и форме промежуточной аттестации.

Во время последующих аудиторных занятий – доводит до студентов информацию о



результатах текущего контроля успеваемости.

К промежуточной аттестации необходимо готовиться целенаправленно, регулярно, систематически и с первых дней обучения по данной дисциплине. Попытки освоить дисциплину в период зачётно-экзаменационной сессии, как правило, показывают не удовлетворительные результаты. В самом начале изучения учебной дисциплины познакомьтесь со следующей учебно-методической документацией:

- программой дисциплины;
- перечнем знаний и умений, которыми студент должен владеть;
- тематическими планами лекций, семинарских занятий;
- контрольными мероприятиями;
- учебником, учебными пособиями по дисциплине, а также
- электронными ресурсами;
- перечнем вопросов к экзамену

После этого у вас должно сформироваться четкое представление об объеме и характере получаемых знаний и умений по дисциплине. Систематическое выполнение учебной работы на лекциях и практических занятиях позволит успешно освоить дисциплину и создать хорошую базу для сдачи экзамена.

## **6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине**

### **6.1. Основная литература**

1. Иванов А.А., Олейников С.Я., Бочаров С.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие. Евразийский открытый институт, 2011. <http://www.iprbookshop.ru/10817>
2. Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие Дашков и К 2015 <http://www.iprbookshop.ru/14110>
3. Дармилова Ж.Д. Инновационный менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие для бакалавров. Дашков и К, 2014. <http://www.iprbookshop.ru/24784>

### **6.2. Дополнительная литература**

1. Жуков Е.Ф., Эриашвили Н.Д., Кузнецова Е.И., Васильев Г.А., Поляков В.А. Банковский менеджмент [Электронный ресурс]: учебник. ЮНИТИ-ДАНА, 2012. <http://www.iprbookshop.ru/7028>
2. С.А. Агарков. Инвестиционный менеджмент и риск-анализ, Мурманск, Издательство МГТУ, 2013, 272 с.

### **6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы**

1. Дамодаран А. Стратегический риск-менеджмент, Москва, «И.Д. Вильямс», 2010, 496 с.
2. Федосеева Р.Н. (ред.), Управление рисками: превентивный подход, Москва, Экономика, 2013, 261 с.
3. Зотов В.В. Доходность и риски инвестиционных проектов в условиях неопределенности, Москва, МГУДТ, 2011, 159 с.

### **6.4. Нормативные правовые документы**

Не используются.

### **6.5. Интернет-ресурсы**

1. [www.nnir.ru](http://www.nnir.ru) / - Российская национальная библиотека
2. [www.nns.ru](http://www.nns.ru) / - Национальная электронная библиотека
3. [www.rsi.ru](http://www.rsi.ru) / - Российская государственная библиотека
4. [www.biznes-karta.ru](http://www.biznes-karta.ru) / - Агентство деловой информации «Бизнес-карта»
5. [www.rbs.ru](http://www.rbs.ru) / - Информационное агентство «РосБизнесКонсалтинг»
6. [www.google.com](http://www.google.com) / - Поисковая система
7. [www.rambler.ru](http://www.rambler.ru) / - Поисковая система
8. [www.yandex.ru](http://www.yandex.ru) / - Поисковая система
9. [www.busineslearning.ru](http://www.busineslearning.ru) / - Система дистанционного бизнес образования
10. <http://www.consultant.ru/> - Консультант плюс
11. <http://www.garant.ru/> - Гарант
12. [www.economist.com/](http://www.economist.com/) - журнал The Economist
13. [www.ft.com](http://www.ft.com) / - газета The Financial Times
14. [www.forbes.com/management](http://www.forbes.com/management) / - Новости бизнеса (менеджмент)
15. [www.management.about.com](http://www.management.about.com) / - Управление и лидерство
16. [www.rbc.ru](http://www.rbc.ru) / - Деловые новости
17. [www.kommersant.ru](http://www.kommersant.ru) / - газета Коммерсантъ
18. [www.vedomosti.ru](http://www.vedomosti.ru) / - газета Ведомости

## **7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы**

Специальные помещения представляют собой учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации. Помещения укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения.

Для проведения занятий лекционного типа предлагаются наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий, обеспечивающие тематические иллюстрации, соответствующие рабочим учебным программам дисциплин.

Каждый обучающийся в течение всего периода обучения обеспечен индивидуальным неограниченным доступом к нескольким электронно-библиотечным системам (электронным библиотекам) и к электронной информационно-образовательной среде организации. Электронно-библиотечная система (электронная библиотека) и электронная информационно-образовательная среда обеспечивают возможность доступа обучающегося из любой точки, в которой имеется доступ к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», как на территории организации, так и вне ее.

Академия обеспечена необходимым комплектом лицензионного программного обеспечения.

Обучающимся обеспечен доступ (удаленный доступ), в том числе в случае применения электронного обучения, дистанционных образовательных технологий, к современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам.

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

Организован доступ к следующим электронным ресурсам:

1. [Bloomberg](#)
2. [EBSCO Publishing](#)
3. [eLIBRARY.RU](#)
4. [Emerging Markets Information Service](#)
5. [Google Scholar \(Google Академия\)](#)
6. [IMF eLibrary](#)
7. [JSTOR](#)
8. [New Palgrave Dictionary of Economics - Электронный словарь.](#)
9. [OECD iLibrary](#)
10. [Oxford Handbooks Online](#)
11. [Polpred.com Обзор СМИ](#)
12. [Science Direct - Журналы издательства Elsevier по экономике и эконометрике, бизнесу и финансам, социальным наукам и психологии, математике и информатике;](#)
13. [SCOPUS](#)
14. [Web of Science](#)
15. [Wiley Online Library](#)
16. [World Bank Elibrary](#)
17. [Архивы научных журналов NEICON](#)
18. [Интернет-сервис «Антиплагиат»](#)
19. [Система Профессионального Анализа Рынков и Компаний «СПАРК»](#)
20. [ЭБС Издательства "Лань"](#)
21. [ЭБС Юрайт](#)
22. [Электронная библиотека Издательского дома «Гребенников»](#)