

**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 2019 г.
№1

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.03.01 РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

направление подготовки
38.04.02

направленность (профиль):
«Технологическое предпринимательство»

квалификация (степень) выпускника
магистр

форма обучения
очно-заочная

Год набора - 2020

Москва, 2019 г.

Авторы–составители:

к.э.н, доцент кафедры теории и систем отраслевого управления Маслевич Т.П.

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

СОДЕРЖАНИЕ

| | |
|---|-----------|
| 1. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ..... | 4 |
| 2. ОБЪЕМ И МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ..... | 6 |
| 3. СОДЕРЖАНИЕ И СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ..... | 6 |
| 4. МАТЕРИАЛЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ ОБУЧАЮЩИХСЯ И ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ..... | 9 |
| 4.1. Текущий контроль успеваемости..... | 9 |
| 4.1.1. <i>Формы текущего контроля успеваемости.....</i> | <i>9</i> |
| 4.1.2. <i>Материалы текущего контроля успеваемости.....</i> | <i>9</i> |
| 4.2. Промежуточная аттестация..... | 17 |
| 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>17</i> |
| 4.2.2. <i>Форма и средства (методы) проведения промежуточной аттестации</i> | <i>18</i> |
| 4.2.3. <i>Типовые оценочные средства.....</i> | <i>18</i> |
| 4.3. Методические материалы..... | 19 |
| 5. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ..... | 20 |
| 6. УЧЕБНАЯ ЛИТЕРАТУРА И РЕСУРСЫ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ "ИНТЕРНЕТ", УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ..... | 26 |
| 6.1. Основная литература..... | 26 |
| 6.2. Дополнительная литература..... | 26 |
| 6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы..... | 26 |
| 6.4. Нормативные правовые документы..... | 26 |
| 6.5. Интернет-ресурсы..... | 26 |
| 6.6. Иные источники..... | 26 |
| 7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКАЯ БАЗА, ИНФОРМАЦИОННЫЕ ТЕХНОЛОГИИ, ПРОГРАММНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ И ИНФОРМАЦИОННЫЕ СПРАВОЧНЫЕ СИСТЕМЫ..... | 28 |

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

1.1. Дисциплина Б1.В.ДВ.03.01 «Риск-менеджмент» обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

| Код компетенции | Наименование компетенции | Код этапа освоения компетенции | Наименование этапа освоения компетенции |
|-----------------|---|--------------------------------|---|
| ДПК-2 | Способность в условиях сокращения продолжительности жизненных циклов товаров, технологий, организаций выявлять рыночные возможности и разрабатывать бизнес-планы создания новых организаций, направлений деятельности и продуктов | ДПК-2.3 | Способность анализировать бизнес-инициативы заинтересованных сторон и разрабатывать бизнес-планы создания новых организаций, направлений деятельности и продуктов |

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

| Обобщенные трудовые функции и трудовые функции | Код этапа освоения компетенции | Результаты обучения |
|---|--------------------------------|--|
| Профессиональный стандарт Руководитель проектов в области информационных технологий Обобщенные трудовые функции В. Управление проектами в области ИТ малого и среднего уровня сложности в условиях неопределенностей, порождаемых запросами на изменения, с применением формальных инструментов управления рисками и проблемами проекта Трудовые функции В/31.7 Планирование в проектах малого и среднего уровня сложности в области ИТ Профессиональный стандарт | ДПК-2.3 | <u>на уровне знаний:</u> <ul style="list-style-type: none"> • демонстрирует знание основных понятий и категорий риск-менеджмента • перечисляет все функции управления рисками предприятия • классифицирует рисковые события |
| | | <u>на уровне умений:</u> <ul style="list-style-type: none"> • анализирует и оценивает по известным критериям возможные сценарии развития предприятия • аргументирует выбор сценария развития бизнес направления с учетом рыночной конъюнктуры • выбирает метод управления риском, подходящий для анализируемой бизнес-ситуации • анализирует условия развития предприятия и выявлены возможные риски • составляет карту рисков проекта • указывает и аргументирует причины для разработки стандартов и фреймворков по управлению рисками |
| | | <u>на уровне навыков:</u> <ul style="list-style-type: none"> • рассчитывает VaR для проекта по заданным условиям |

| | | |
|--|--|--|
| <p>Менеджер продуктов в области информационных технологий Обобщенные трудовые функции</p> <p>D. Управление портфелем продуктов и подразделением управления продуктами</p> <p>Трудовые функции</p> <p>D/05.7 Организация продажи и покупки активов, способствующих увеличению успешности портфеля продуктов</p> | | |
|--|--|--|

2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы

Место дисциплины

Дисциплина Б1.В.ДВ.03.01 «Риск-менеджмент» относится к дисциплинам по выбору вариативной части образовательной программы магистратуры по направлению подготовки 38.04.02 «Менеджмент» (направленность (профиль) «Технологическое предпринимательство» и изучается в 3 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 – 24 академических часов/18 астрономических часов. На самостоятельную работу обучающихся отводится 76 академических часов/57 астрономических часа.

3. Содержание и структура дисциплины

| № | Наименование тем и/или разделов | Объем дисциплины, ак.час | | | | | | Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации |
|--------------------------|---|--------------------------|---|--------|----|-----|----|--|
| | | всего | Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий | | | | СР | |
| | | | Л | Л Р | ПЗ | КСР | | |
| Тема 1 | Риск и неопределенность бизнес-среды | 18 | 2 | | 4 | | 12 | Т№1 |
| Тема 2 | Принятие решений в условиях риска | 19 | 1 | | 4 | | 14 | ПКР |
| Тема 3 | Риск-менеджмент: роль и место в общей системе менеджмента | 17 | 1 | | 4 | | 12 | Э №1 |
| Тема 4 | Методы анализа и оценки рисков | 18 | 2 | | 4 | | 12 | ГТЗ |
| Тема 5 | Методы управления рисками | 19 | 1 | | 4 | | 14 | КТ |
| Тема 6 | Построение системы риск-менеджмента | 17 | 1 | | 4 | | 12 | Э №2 |
| Промежуточная аттестация | | | За | | | | | |
| Всего: | | 108 | 8 | | 24 | | 76 | |

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

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

4.1.1. Формы текущего контроля успеваемости

В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.03.01 «Риск-менеджмент» текущий контроль успеваемости проводится в устной и письменной формах. 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 |

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

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 Р1, Р2, Р3, Р4, 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 |
| Р1 | 0,4 | 0,34 | 0,3 |
| Р2 | 0,7 | 0,15 | 0,2 |
| Р3 | 0,4 | 0,7 | 0,05 |
| Р4 | 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?

- А. принятие риска
- В. передача риска
- С. 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 в условиях сокращения продолжительности жизненных циклов товаров, технологий, организаций выявлять рыночные возможности и разрабатывать бизнес-планы создания новых организаций, направлений деятельности и продуктов | ДПК-2.3 | Способность анализировать бизнес-инициативы заинтересованных сторон и разрабатывать бизнес-планы создания новых организаций, направлений деятельности и продуктов |

| Этап освоения компетенции | Показатель Оценивания | Критерий оценивания |
|---------------------------|--|---|
| ДПК-2.3 | <ul style="list-style-type: none"> определяет уровень инновационной активности, инновационной восприимчивости, инновационного потенциала, инновационных возможностей в организации разрабатывает стратегию и программы инновационного развития организации с учетом функциональных стратегий организации разрабатывает бизнес-план создания новых организаций, направлений деятельности и продуктов | <ul style="list-style-type: none"> проведена оценка инновационного климата в организации и проведена корректировка целей инновационного менеджмента выявлены факторы, влияющие на формирование и развитие инновационной активности разработаны предложения по программе стимулирования инновационной активности и творчества персонала организации проведен анализ и оценка инновационного потенциала организации, определены пути его развития проведен анализ в запросов на изменения и бизнес-инициатив заинтересованных сторон и сформированы целевые ориентиры развития бизнеса |

4.2.2. Форма и средства (методы) проведения промежуточной аттестации

По дисциплине Б1.В.ДВ.03.01 «Риск-менеджмент» учебным планом предусмотрен зачет, который проводится в письменной форме и подразумевает решение задач.

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 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 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

Промежуточная аттестация по дисциплине Б1.В.ДВ.03.01 «Риск-менеджмент» проводится в виде письменного ответа студента на вопросы билета.

Каждый билет состоит из 3 заданий в форме задач и кейсов.

На выполнение заданий студенту отводится 90 минут. После проверки преподавателем ответов(решений) на каждое задание студенту могут быть заданы дополнительные уточняющие вопросы. В случае если студент при ответе допустил несущественные неточности, ему могут быть заданы дополнительные вопросы по темам курса.

Шкала оценивания для промежуточной аттестации:

| Оценка | Требования к результатам |
|-------------|---|
| «зачтено» | Оценка «зачтено» выставляется, если студентом: <ol style="list-style-type: none">1. на профессиональном уровне с использование современного инструментария риск-менеджмента проведена оценка влияния неопределенности и риска на результаты деятельности2. грамотно выбран метод управления риском, подходящий для анализируемой бизнес-ситуации3. выбрана оптимальная стратегия с учетом неопределённости и риска |
| «незачтено» | Оценка «незачтено» выставляется, если студентом: <ol style="list-style-type: none">1. не проведена оценка влияния неопределенности и риска на результаты деятельности2. выбран метод управления риском, не подходящий для анализируемой бизнес-ситуации3. выбрана не оптимальная стратегия с учетом неопределённости и риска |

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Процесс обучения по дисциплине Б1.В.ДВ.03.01 «Риск-менеджмент» включает следующие основные виды занятий:

1. лекции;
2. практические занятия;
3. 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: выполнение творческих заданий, тестирований, разбор типовых ситуаций.

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. законспектируйте главы из основных источников литературы, соответствующие изучаемой теме;
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 по отдельным темам учебной программы.

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:

1. программой дисциплины;

2. перечнем знаний и умений, которыми студент должен владеть;
3. тематическими планами лекций, семинарских занятий;
4. контрольными мероприятиями;
5. учебником, учебными пособиями по дисциплине, а также
6. электронными ресурсами;
7. типовым вариантом задания к промежуточной аттестации.

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 прохождения промежуточной аттестации.

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

6.1. Основная литература

6. Иванов А.А., Олейников С.Я., Бочаров С.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие. Евразийский открытый институт, 2011. <http://www.iprbookshop.ru/10817>
7. 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>
8. 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>

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 используется

6.5. Интернет-ресурсы

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

6.6. Иные источники

1. Федеральная программа «Доступная среда» на 2011–2015 годы
2. Федеральная программа «Социальная поддержка граждан»

3. Федеральная программа «Содействие занятости населения»
4. Федеральная программа «Развитие здравоохранения»
5. Федеральная программа «Информационное общество (2011–2020 годы)»
6. Федеральная программа «Развитие культуры и туризма» на 2013–2020 годы
7. Федеральная программа «Развитие образования на 2013–2020 годы»
8. Федеральная программа «Обеспечение доступным и комфортным жильем и коммунальными услугами граждан Российской Федерации»
9. Федеральная программа «Развитие физической культуры и спорта»
10. Федеральная программа «Защита населения и территорий от чрезвычайных ситуаций, обеспечение пожарной безопасности и безопасности людей на водных объектах»

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.

Организован доступ к следующим электронным ресурсам:

- [Bloomberg](#)
- [EBSCO Publishing](#)
- [eLIBRARY.RU](#)
- [Emerging Markets Information Service](#)
- [Google Scholar \(Google Академия\)](#)
- [IMF eLibrary](#)
- [JSTOR](#)
- [New Palgrave Dictionary of Economics - Электронный словарь.](#)
- [OECD iLibrary](#)
- [Oxford Handbooks Online](#)
- [Polpred.com ОбзорСМИ](#)
- [ScienceDirect - Журналы издательства Elsevier по экономике и эконометрике, бизнесу и финансам, социальным наукам и психологии, математике и информатике;](#)
- [SCOPUS](#)
- [Web of Science](#)
- [Wiley Online Library](#)
- [WorldBankElibrary](#)
- [Архивы научных журналов NEICON](#)
- [Интернет-сервис «Антиплагиат»](#)
- [Система Профессионального Анализа Рынков и Компаний «СПАРК»](#)
- [ЭБС Издательства "Лань"](#)
- [ЭБС Юрайт](#)
- [Электронная библиотека Издательского дома «Гребенников»](#)