МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Ярославский государственный университет им. П.Г. Демидова

Кафедра управления и предпринимательства

УТВЕРЖДАЮ
Декан экономического факультета

_____ Д.Ю. Брюханов
(подпись)

«18» мая 2022 г.

Рабочая программа дисциплины «Управление рисками проекта»

Направление подготовки
38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль)
«Управление проектами»

Форма обучения
очная

Программа одобрена
на заседании кафедры
от «11» мая 2022 г., протокол №8

Программа одобрена НМК
экономического факультета
протокол №5 от «11» мая 2022 г.

Ярославль, 2022

1. Цели освоения дисциплины.

Целями преподавания дисциплины «Управление рисками проекта» являются:

- формирование у студентов навыков идентификации, анализа рисков и принятия решений, которые включают максимизацию положительных и минимизацию отрицательных последствий наступления рисковых событий.

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы.

Дисциплина «Управление рисками проекта» относится к дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений, Блока 1. Курс базируется на знаниях, полученных обучающимися при прохождении дисциплин «Основы управления проектом», «Управленческие решения», «Стратегический менеджмент». Знания и навыки, полученные студентами при изучении дисциплины «Управление рисками проекта» используются в дальнейшем при изучении различных дисциплин, таких как «Гибкие методы управления проектом», «Управление инвестиционными проектами».

3. Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО, ООП ВО и приобретения следующих знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности:

Формируемая компетенция (код и формулировка)	**Индикатор достижения компетенции (код и формулировка)**	**Перечень планируемых результатов обучения**
Универсальные компетенции		
ПК(ОУ)-4. Способен разрабатывать мероприятия по воздействию на риск в проекте	**ПК (ОУ) -4.1.** Оценивает вероятности отдельных видов риска	**Знать:** • инструменты анализа существующих методов контроля рисков и управления рисками и их достаточности; • инструменты анализа последствий рисков; • принципы и правила выбора метода, техники оценки риска (достаточность ресурсов, характер и степень неопределенности, сложность метода, техники) **Уметь:** • определять эффективные методы воздействия на риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной

		оценке риска и разработке мероприятий по их управлению.
	ПК (ОУ) -4.3. Анализирует и оценивает риски с позиции их идентификации по функциональным областям	**Знать:** • методы, техники, технологии управления различными видами риска **Уметь:** • использовать программное обеспечение для работы с информацией (текстовые, графические, табличные и аналитические приложения, приложения для визуального представления данных) на уровне опытного пользователя **Владеть:** • навыками формирования формы отчетности, дорожных карт для целей реализации и мониторинга мероприятий по воздействию на риски.
ПК(ОУ)- 5. Способен документировать процесс управления риска и корректировать реестр рисков в проекте	**ПК (ОУ) -5.1.** Формирует базу данных и разрабатывает организационно-управленческую документацию с использованием современных технологий электронного документооборота	**Знать:** • принципы и правила выбора метода, техники оценки риска (достаточность ресурсов, характер и степень неопределенности, сложность метода, техники)
	ПК (ОУ) -5.2. Осуществляет расчеты, прогнозирует, тестирует методики анализа рисков с учетом отраслевой специфики	**Уметь:** • определять эффективные методы воздействия на риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками - владельцами риска), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке риска и разработке мероприятий по их управлению**.**
	ПК (ОУ) -5.3. Осуществляет мониторинг рисков по	**Знать:** • инструменты анализа существующих методов контроля рисков и

	функциональным областям, тестирует и верифицирует методики анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям	управления рисками и их достаточности; • инструменты анализа последствий рисков; **Владеть:** • навыками оценки деятельности подразделений по воздействию на риски

4. Объем, структура и содержание дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы, 108 академических часов.

Очная форма

№ п/п	Темы (разделы) дисциплины, их содержание	Семестр	Виды учебных занятий, включая самостоятельную работу студентов, и их трудоемкость (в академических часах)						Формы текущего контроля успеваемости Форма промежуточной аттестации (по семестрам) Формы ЭО и ДОТ (при наличии)
			Контактная работа					самостоятельная работа	
			лекции	практические	лабораторные	консультации	аттестационные испытания		
1	Теоретические основы управления рисками	7	4	4				8	Опрос Практические задания
	в том числе с ЭО и ДОТ							4	Материалы в LMS Moodle: - презентация; - конспект лекций; - задачи
2	Классификация рисков	7	4	4				8	Опрос Практические задания
	в том числе с ЭО и ДОТ							4	Материалы в LMS Moodle: - презентация; - конспект лекций; - задания для самостоятельного выполнения
3	Анализ и оценка степени риска	7	4	4		1		8	Дискуссия Практические задания
	в том числе с ЭО и ДОТ							4	Материалы в LMS Moodle: - презентация;

№ п/п	Темы (разделы) дисциплины, их содержание	Семестр	Виды учебных занятий, включая самостоятельную работу студентов, и их трудоемкость (в академических часах)						Формы текущего контроля успеваемости Форма промежуточной аттестации (по семестрам) Формы ЭО и ДОТ (при наличии)
			Контактная работа					самостоятельная работа	
			лекции	практические	лабораторные	консультации	аттестационные испытания		
									- конспект лекций; - задачи для самостоятельного решения
4	Управление рисками как система менеджмента	7	4	4		1		8	Опрос Практические задания
	в том числе с ЭО и ДОТ							4	Материалы в LMS Moodle: - презентация; - конспект лекций; - задание для текущего контроля
5	Отраслевое управление рисками	7	4	4		1		8	Дискуссия
	в том числе с ЭО и ДОТ							4	Материалы в LMS Moodle: - презентация; - конспект лекций
6	Риск-менеджмент в разрезе инвестиционной стратегии	7	8	6		1		8	Опрос Практические задания
	в том числе с ЭО и ДОТ							2	Материалы в LMS Moodle: - презентация; - конспект лекций
								2	Контрольное задание по пройденному курсу в LMS Moodle(итоговый тест)
						1	0,3	0,7	Зачет
	ИТОГО	**108**	**28**	**26**		**5**	**0,3**	**48,7**	
	в том числе с ЭО и ДОТ							**24**	

Содержание разделов дисциплины:

Тема 1. Теоретические основы управления рисками

Риск, его понятие, сущность. Вероятностный характер риска. Объективный характер возникновения риска и субъективность его оценки. Значение риска в предпринимательской деятельности. Понятие экономического риска. Основные черты, присущие экономическому риску. Историческое развитие взглядов ведущих экономистов на понятие риска. Основные

научные концепции риска. Классическая и неоклассическая теория предпринимательских рисков. Классическое понимание риска как возможности возникновения потерь (ущерба) от предпринимательской деятельности. Величина прибыли и ее колебания как основы неоклассической теории предпринимательских рисков.

Тема 2. Классификация рисков

Основные методы управления рисками, их характеристика. Страхование как метод управления рисками предприятия. Историческое развитие института страхования. Основные понятия (термины), применяемые в страховании (страховщик, страхователь, страховой тариф, страховая премия, франшиза и пр.). Полное и частичное страхование рисков. Пропорциональное и непропорциональное частичное страхование рисков. Основные преимущества страхования как метода управления риском. Объективные и субъективные недостатки страхования как метода управления риском. Критерии выбора страховой компании. Понятие кэптивной страховой компании. Преимущества и недостатки кэптивного страхования. Проектные риски.

Тема 3. Анализ и оценка степени риска

Диалектика как метод анализа и управления риском. Качественный и количественный анализ риска. Измерение риска. Вероятность как показатель риска. Абсолютные и относительные характеристики риска. Экспертные и статистические методы анализа риска и оценки его существенности. Применение теории стратегических игр в управлении риском. Финансовые решения в условиях риска. Анализ финансовых коэффициентов и безубыточности предприятия. Зона и уровень безубыточности. Шкала и уровень риска.

Тема 4. Управление рисками как система менеджмента

Место и роль подразделения по управлению рисками проекта в системе корпоративного управления предприятия. Зависимость его организационно-штатной структуры от размера и профиля деятельности предприятия.

Тема 5. Отраслевое управление рисками

Система операционных риск-индикаторов предприятия: понятие, значение, задачи. Основные принципы формирования риск-индикаторов хозяйственных процессов. Риск-индикаторы блока «Проект». Обеспеченность ресурсами. Сравнительный уровень затрат на прирост прогнозных ресурсов. Сравнительный уровень затрат проект.

Тема 6. Риск-менеджмент в разрезе инвестиционной стратегии

Зависимость неопределенности внешней среды функционирования и эффективности предпринимательской деятельности. Общий график «риск-прибыль». Задачи риск менеджмента (выявление, оценка, анализ, управление рисками и пр.). Неразрывность зависимости стратегии и тактики риск-менеджмента.

5. Образовательные технологии, в том числе технологии электронного обучения и дистанционные образовательные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

В процессе обучения используются следующие образовательные технологии:

1) **Академическая лекция** – последовательное изложение материала преподавателем, рассмотрение теоретических и методологических вопросов дисциплины в логически выдержанной форме. В процессе лекции преподаватель стимулирует студентов к

участию в обсуждении вопросов и высказыванию собственной точки зрения обсуждаемой проблематики. Цели и требования к академической лекции: современный научный уровень, информативность, системное освещение ключевых понятий и положений по соответствующей теме, обзор и оценка существующей проблематики, дача методических рекомендаций студентам для дальнейшего изучения курса.

Практическое (семинарское) занятие – занятие, посвященное практической отработке у студентов конкретных умений и навыков при изучении дисциплины, закреплению полученных на лекции знаний и оценке результатов обучения в процессе текущего контроля.

На первом практическом занятии в вводной части дается первое целостное представление о дисциплине. Студенты знакомятся с назначением и задачами дисциплины, её ролью и местом в образовательной программе. При этом озвучиваются методические и организационные особенности работы в рамках данной дисциплины, а также дается анализ рекомендуемой учебно-методической литературы. Продолжительность вводной части составляет не более 10-15 минут.

При проведении практических занятий используются такие инновационные методы обучения, как диалог-собеседование, коллективное обсуждение тематических вопросов, разбор практических ситуаций, нормативных документов, теоретических и методических аспектов по темам дисциплины. Обсуждение и оценка правильности выполненных различного типа заданий, указанных в фонде оценочных средств рабочей программы, производится коллективно студентами под руководством преподавателя.

Консультации – вид учебных занятий, являющиеся одной из форм контроля самостоятельной работы студентов в течение семестра. На консультациях по инициативе студентов рассматриваются и обсуждаются различные вопросы тематики дисциплины, которые возникают у них в процессе самостоятельной работы.

В процессе обучения используются следующие технологии электронного обучения и дистанционные образовательные технологии:

Электронный университет Moodle ЯрГУ, в котором присутствуют:

- задания для самостоятельной работы обучающихся по темам дисциплины;
- средства текущего контроля успеваемости студентов (тестирование);
- презентации и тексты лекций по темам дисциплины;
- представлен список учебной литературы, рекомендуемой для освоения дисциплины;
- представлена информация о форме и времени проведения консультаций по дисциплине в режиме онлайн;
- посредством форума осуществляется синхронное и (или) асинхронное взаимодействие между обучающимися и преподавателем в рамках изучения дисциплины.

6. Перечень лицензионного и (или) свободно распространяемого программного обеспечения, используемого при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

В процессе осуществления образовательного процесса по дисциплине используются:

1) для формирования материалов для текущего контроля успеваемости и проведения промежуточной аттестации, для формирования методических материалов по дисциплине:

- программы Microsoft Office;
- Adobe Acrobat Reader DC.

7. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (при необходимости)

В процессе осуществления образовательного процесса по дисциплине используются:

Автоматизированная библиотечно-информационная система «БУКИ-NEXT» http://www.lib.uniyar.ac.ru/opac/bk_cat_find.php

Программное обеспечение:

- операционная система Windows;
- программы Microsoft Office;

Информационные справочные системы, в т.ч. профессиональные базы данных:

- справочная правовая система КонсультантПлюс.

8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (при необходимости), рекомендуемых для освоения дисциплины

а) основная литература:

Энциклопедия финансового риск-менеджмента / ред. А.А Лобанов ; ред. А. Чугунов, 2009

Управление рисками предприятия: Учеб. пособие / В.Н. Уродовских, 2010. https://www.alt-invest.ru/wp-content/uploads/lib-book-risk-management.pdf

Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие / Н.А. Рыхтикова, 2009

б) дополнительная литература

Макаревич Л.М. Управление предпринимательскими рисками. – М.: Издательство «Дело и Сервис», 2006. https://dlib.rsl.ru/01002923973

Шапкин А.С., Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций.- 3-е изд. - М.: «Дашков и К», 2008. https://vse-ychebniki.ru/upravlenie-riskami-uchebnik/shapkin-ekonomicheskie-i-finansovye-riski/

в) ресурсы сети «Интернет»

1. Электронный каталог Научной библиотеки ЯрГУ (https://www.lib.uniyar.ac.ru/opac/bk_cat_find.php).
2. Электронная библиотечная система (ЭБС) издательства «Юрайт» (https://www.urait.ru).
3. Электронная библиотечная система (ЭБС) издательства «Проспект» (http://ebs.prospekt.org/).
4. Научная электронная библиотека (НЭБ) (http://elibrary.ru)

9. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине включает в свой состав специальные помещения:

- учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа;
- учебные аудитории для проведения практических занятий (семинаров);
- учебные аудитории для проведения групповых и индивидуальных консультаций;
- учебные аудитории для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации;
- помещения для самостоятельной работы;
- помещения для хранения и профилактического обслуживания технических средств обучения.

Специальные помещения укомплектованы средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде ЯрГУ.

Автор:

Доцент кафедры управления и предпринимательства		Д.Е. Воронцов
должность, ученая степень	*подпись*	*И.О. Фамилия*

Приложение №1 к рабочей программе дисциплины
«Управление рисками проекта»

Фонд оценочных средств
для проведения текущей и промежуточной аттестации студентов
по дисциплине

1. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

1.1 Контрольные задания и иные материалы, используемые в процессе текущей аттестации

Задания для проведения текущего контроля по теме
1. Теоретические основы управления рисками

Вопросы к опросу

1. Этапы диагностики рисков компании
2. Определение рискового спектра компании. Понятия: рисковое поле, рисковый
3. Метод сценариев оценки риска
4. Количественный анализ рисков. Методы (модели) количественной оценки рисков
5. Оценка влияния каждого показателя по методу дерева решений в управлении риском
6. Метод Монте-Карло (статистических испытаний)
7. Методы экспертных оценок риска. Метод "Дельфи".
8. Координация (согласование) мнений экспертов.
9. Что представляет собой расчет индекса Трейнора. С какой целью он рассчитывается
10. Ставка свободная от риска. Доходность безрисковых активов

Практические задания

Задание 1.Пусть имеются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,6 обеспечивает прибыль 15 млн руб., однако с вероятностью 0,4 можно потерять 5,5 млн руб. Для второго проекта с вероятностью 0,8 можно получить прибыль 10 млн руб. и с вероятностью 0,2 потерять 6 млн руб. Какой проект выбрать?

Задание 2.

Реальные распределения вероятностей могут существенно отличаться от нормального. Насколько сильно будут искажены наши выводы, если в наших рассуждениях мы будем исходить только из нормального закона распределения вероятностей?
Ответ: а) затрудняюсь ответить; б) существенно искажены; в) искажения будут несущественными.

Задания для проведения текущего контроля по теме
2. Классификация рисков

Вопросы к опросу

1. Премия риска рыночного портфеля
2. Размер премии за риск инвестирования в акционерный капитал, ERP - Implied Equity Risk Premium
3. Методы, используемые на этапе выявления рисков
4. Избежание риска как наиболее простой метод управления рисками, выбор мероприятий

5. Принятие (сохранение) риска, оправданность выбора
6. Принципы стратегии риск-менеджмента: принцип максимизации, принцип минимизации, принцип адекватности, принцип принятия
7. Правила стратегии риск-менеджмента: максимум выигрыша, оптимальная вероятность результата, оптимальная колеблемость результата, оптимальное сочетание выигрыша и величины риска.
8. Эвристические правила риск -менеджмента
9. Особенности и цели проведения финансового анализа рисков корпоративных организаций
10. Факторы, влияющие на уровень финансовых рисков корпорации: объективные и субъективные.

Практические задания

Выбор альтернативы. Компания изучает возможность производства и сбыта навесов для хранения кормов. Проект может основываться на большой или малой производственной базе. Рынок для реализации навесов может быть благоприятным или неблагоприятным. Менеджер компании учитывает возможность вообще не производить эти навесы. При благоприятной рыночной ситуации большое производство позволило бы менеджеру получить чистую прибыль 200 тыс. руб. Если рынок окажется неблагоприятным, то при большом производстве компания понесет убытки в размере 180 тыс. руб. Малое производство дает 100 тыс. руб. прибыли при благоприятной рыночной ситуации и 20 тыс. руб. убытков при неблагоприятной. Вопрос: Какую альтернативу следует выбрать?

Задания для проведения текущего контроля по теме
3. Анализ и оценка степени риска

Вопросы для дискуссии

1. Поясните проблемы принятия решений, в которых речь идет о будущих полезных результатах.
2. Чем определяется неопределенность будущих результатов, а также риски при принятии решений в сфере бизнеса?
3. В чем состоят особенности влияния различных факторов риска на будущие результаты?
4. Поясните особенности влияния неустранимой неопределенности на будущие результаты.
5. Какие формы моделирования неопределенности будущих результатов вы можете отметить?
6. В чем заключаются особенности риска как результата моделирования неопределенности? В чем состоит субъективный характер подобных моделей?
7. Поясните основные формы оценки или измерения риска.

Практические задания для обсуждения

Задание 1. Покажите, как в современных условиях усиливается влияние факторов риска на развитие экономических процессов.
Задание 2. Обсудите, в чем состоят сложности и проблемы развития экономического кризиса 2008 г., почему выход из кризиса затянулся на достаточно длительный период.

Задания для проведения текущего контроля по теме
4. Управление рисками как система менеджмента

Вопросы к опросу

1. Какова специфика измерения риска в условиях конкретного бизнеса?
2. Почему рисковые оценки не позволяют однозначно прогнозировать будущий результат?

3. В чем заключается основная задача управления рисками бизнеса в реальном секторе экономики?
4. Поясните особенности оценки стоимости рискового капитала на основе моделируемых распределений будущих результатов.
5.Перечислите основные разделы теории управления рисками.
6. Чем определяются риски при принятии решений в сфере реального бизнеса?
7. В чем состоят основные задачи управления рисками в сфере реальной экономики?
8. Каковы различия между единичным и корпоративным рисками проекта?

Практические задания

Принятие решения об использовании дополнительной информации.

Предположим, что менеджер компании связался с фирмой, занимающейся исследованием рынка, которая предложила ему помощь в принятии решения о том, стоит ли создавать производство навесов дли хранения кормов. Исследователи рынка утверждают, что их анализ позволит установить с полной определенностью, будет ли рынок благоприятным для данного продукта. Другими словами, условия для компании меняются от принятия решений в условиях риска к принятию решений в условиях определенности. Эта информация может предостеречь менеджера от очень дорогостоящей ошибки. Фирма, занимающаяся исследованием рынка, хотела бы получить за эту информацию 65 тыс. руб. Вопрос: Следует ли воспользоваться услугами указанной фирмы? Даже если результаты исследования являются совершенно точными, оправдана ли плата 65 тыс. руб.?

Задания для проведения текущего контроля по теме

5. Отраслевое управление рисками

Вопросы к дискуссии

1. Финансовое состояние корпорации и риск банкротства. Основные направления восстановления платежеспособности и снижения риска банкротства корпорации.
2. Понятие риска в научном и прикладном значениях
3. Субъективная основа предпринимательского риска. Типы отношения к риску ЛПР
4. Отношение компаний к риску и подходы к управлению рисками. Толерантность к риску
5. Отношение компаний к риску и подходы к управлению рисками. Толерантность к риску
6. В чем различие между чистыми и спекулятивными рисками. Назовите примеры тех и других.
7. Какие классификации рисков Вам известны
8. Выявление потенциальных областей риска, диагностика и оценка возможности предотвращения или минимизации возникновения рисков
9. Управленческие инструменты и механизмы, обеспечивающие эффективную диагностику рисков.
10. Этапы диагностики рисков компании
11. Определение рискового спектра компании. Понятия: рисковое поле, рисковый ландшафт, рисковый профиль
12. Установление актуального рискового профиля
13. Абсолютные показатели колеблемости (вариации)
14. Рисковость актива и портфеля
15. Метод анализа чувствительности в управлении риском.
16. Метод сценариев оценки риска
17. Количественный анализ рисков. Методы (модели) количественной оценки рисков

Задания для проведения текущего контроля по теме

6. Риск-менеджмент в разрезе инвестиционной стратегии

Вопросы к опросу

1. Оценка влияния каждого показателя по методу дерева решений в управлении риском
2. Метод Монте-Карло (статистических испытаний)
3. Методы экспертных оценок риска. Метод "Дельфи".
4. Координация (согласование) мнений экспертов.
5. Что представляет собой расчет индекса Трейнора. С какой целью он рассчитывается
6. Ставка свободная от риска. Доходность безрисковых активов
7. Премия риска рыночного портфеля
8. Размер премии за риск инвестирования в акционерный капитал, ERP - Implied Equity Risk Premium
9. Методы, используемые на этапе выявления рисков
10. Избежание риска как наиболее простой метод управления рисками, выбор мероприятий
11. Принятие (сохранение) риска, оправданность выбора
12. Принципы стратегии риск-менеджмента: принцип максимизации, принцип минимизации, принцип адекватности, принцип принятия
13. Правила стратегии риск-менеджмента: максимум выигрыша, оптимальная вероятность результата, оптимальная колеблемость результата, оптимальное сочетание выигрыша и величины риска.
14. Эвристические правила риск -менеджмента
15. Особенности и цели проведения финансового анализа рисков корпоративных организаций
16. Факторы, влияющие на уровень финансовых рисков корпорации: объективные и субъективные.

Практические задания

Взаимосвязанные решения. Предположим, что менеджеру надо принять два решения, причем второе решение зависит от исхода первого. Прежде чем создать новое производство, менеджер намерен заказать исследование рынка и заплатить за него 10 тыс. руб. Результаты этого исследования могли бы помочь решить вопрос о том, следует ли создавать большое производство, малое производство или не делать ничего. Менеджер понимает, что такое обследование рынка не может дать достоверную информацию, но может, тем не менее, оказаться полезным.
Вопрос: Следует ли проводить обследование рынка?

Критерии оценки решения практических и индивидуальных заданий

При решении практических (ситуационных) заданий разрешено пользоваться табличными, нормативными, специализированными управленческими, вероятностно-статистическими, экономико-финансовыми справочными материалами.
Оценка «отлично» - студент ясно изложил условие решения задания с обоснованием точной ссылкой на формулы / правила / закономерности / явления;
Оценка «хорошо» - студент изложил условие решения задания, но с отдельными несущественными неточностями при ссылках на формулы / правила / закономерности / явления;
Оценка «удовлетворительно» - студент в целом изложил условие решения задания, но с отдельными существенными неточностями при ссылках на формулы / правила / закономерности / явления;
Оценка «неудовлетворительно» - студент не уяснил условие решения задания или решение не обосновал ссылками на формулы / правила / закономерности / явления.

Критерии оценки теста

Тест – инструмент оценивания уровня знаний студентов, состоящий из системы тестовых заданий, стандартизованной процедуры проведения, обработки и анализа результатов.

Оценка «отлично» выставляется при условии правильного ответа студента на более чем 85 % тестовых заданий.

Оценка «хорошо» выставляется при условии правильного ответа студента на 71-85 % тестовых заданий.

Оценка «удовлетворительно» выставляется при условии правильного ответа на 56-70 % тестовых заданий.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется при условии правильного ответа на 55 % тестовых заданий и менее.

1.2 Список вопросов и (или) заданий для проведения промежуточной аттестации

Вопросы к зачету

1.Управление инвестиционным риском.
2. Проектные риски.
3. Сущность понятия «риск». Риск и неопределенность. Вероятностных характер понятия «риск».
4. Понятие риска как экономической категории. Предпосылки возникновения и основные черты экономического риска. График «риск-прибыль».
5. Уровень освещенности теории предпринимательских рисков в трудах современных экономистов.
6. Историческое развитие взглядов ведущих экономистов на понятие риска. Основные научные концепции риска.
7. Риски и экономическая безопасность предприятия. Корпоративные войны.
8. Особенности классической теории экономического риска.
9. Особенности неоклассической теории экономического риска.
10. Общая классификация рисков.
11. Особенности операционного риска.
12. Особенности кредитного риска.
13. Особенности инвестиционного риска.
14. Особенности производственного риска.
15. Особенности коммерческого риска.
16. Особенности процентного риска.
17. Особенности политического риска.
18. Особенности ценового риска.
19. Зависимость внешней среды функционирования и рисков предприятия.
20. Понятие и значение интегрированности рисков.
21. Понятие «риск-менеджмент». Задачи риск-менеджмента.
22. Риск-менеджмент как составная часть корпоративной системы управления.
23. Организация и принципы построения системы управления рисками на предприятии.
24. Значение регламента управления рисками предприятия.
25. Риск-аудит как составная часть системы управления рисками предприятия.
26. Уровень риска. Факторы, влияющие на уровень риска.
27. Сущность управления рисками. Активное и пассивное управление рисками.
28. Общая характеристика методов управления рисками.
29. Страхование как метод управление риском. Основные методы страхования.

Положительные и
отрицательные стороны.
30. Использование кэптивных страховых компаний с целью минимизации рисков. Положительные и
отрицательные стороны.
31. Понятие хеджирования. Хеджирование с помощью финансовых инструментов (опционы,
форвардные контракты и пр.)
32. Лимитирование, резервирование и диверсификация как методы управления риском.
33. Выбор применяемого метода управления в зависимости от вероятности и уровня риска.
34. Основные методы оценки уровня риска.
35. Особенности метода экспертных оценок уровня риска.
36. Особенности статистического метода оценки уровня риска.
37. Понятие и этапы диагностики рисков. Значение карты рисков.
38. Система операционных риск-индикаторов предприятия: понятие, значение, задачи.
39. Риск-индикаторы блока «Проекты». Экономический смысл риск-индикаторов, единицы
измерения.
40. Риск-индикаторы блока «Производство». Экономический смысл риск-индикаторов, единицы
измерения.
41. Понятие и значение показателей VaR.
42. Риск-индикаторы блока «Казначейство». Экономический смысл риск-индикаторов, единицы
измерения. Понятие и значение показателя ROI.
43. Риск-индикаторы блоков «Информационные технологии», «Экономическая безопасность».
Экономический смысл риск-индикаторов, единицы измерения.
44. Риск-индикаторы блоков «Логистика», «Персонал и социальная политика». Экономический
смысл риск-индикаторов, единицы измерения.
45. Риск-индикаторы блока «Имущественные отношения». Экономический смысл риск-индикаторов,
единицы измерения.
46. Понятие инвестиций и инвестиционной деятельности.
47. Факторы инвестиционного риска.
48. Методы оценки инвестиционного риска.
49. Прямые и косвенные инвестиции.

Приложение №2 к рабочей программе дисциплины
«Управление рисками проекта»

Методические указания для студентов по освоению дисциплины

Успешное овладение дисциплиной «Управление рисками проекта», предусмотренное рабочей программой, предполагает выполнение ряда рекомендаций.

1. Следует внимательно изучить материалы, характеризующие курс и определяющие целевую установку. Это поможет четко представить круг изучаемых проблем и глубину их постижения.

2. Необходимо знать подборку литературы, достаточную и необходимую для изучения предлагаемого курса. При этом следует иметь в виду, что нужна литература различных видов:

а) учебники, учебные и учебно-методические пособия.

б) монографии, сборники научных статей, публикаций в экономических журналах, представляющие эмпирический материал, а также многообразные аспекты анализа современного развития организаций;

в) справочная литература – энциклопедии, экономические словари, раскрывающие категориально понятийный аппарат.

г) аналитические материалы.

3. По большинству тем предусмотрены практические занятия, на которых происходит закрепление лекционного материала путем устного опроса и решения практических заданий. Для решения всех заданий необходимо знать и понимать лекционный материал. Поэтому в процессе изучения дисциплины рекомендуется регулярное повторение пройденного лекционного материала. Материал, законспектированный на лекциях, необходимо дома еще раз прорабатывать и при необходимости дополнять информацией, полученной на консультациях, практических занятиях или из учебной литературы.

4. Большое внимание должно быть уделено выполнению домашней работы. В качестве заданий для самостоятельной работы дома студентам предлагаются задания, аналогичные разобранным на лекциях и практических занятиях или немного более сложные.

5. Для проверки и контроля усвоения теоретического материала и приобретенных практических навыков в течение обучения проводятся мероприятия текущей аттестации. Также проводятся консультации (при необходимости) по разбору заданий для самостоятельной работы, которые вызвали затруднения.

6. В конце курса студенты сдают зачет.