

Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение
высшего образования
«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»
(Финансовый университет)

Департамент менеджмента и инноваций
Факультета «Высшая школа управления»

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной и
методической работе

_____ Е.А. Каменева

«28» марта 2023 г.

А.А. Ксенофонтов
РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Рабочая программа дисциплины
для студентов, обучающихся по направлению подготовки
38.03.02 «Менеджмент»,
ОП «Логистика», профиль «Логистика», ОП «Финансовый менеджмент»,
профиль «Финансовый менеджмент», ОП «Управление бизнесом», профиль
«Менеджмент и управление бизнесом»

*Рекомендовано Ученым советом Факультета «Высшая школа управления»
(протокол № 28 от 21.03.2023г.)*

*Одобрено Советом Департамента менеджмента и инноваций
(протокол № 12 от 14.02.2023г.)*

Москва 2023

СОДЕРЖАНИЕ

1. Наименование дисциплины	3
2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы с указанием индикаторов их достижения, соотнесенных с планируемыми результатами обучения по дисциплине	3
3. Место дисциплины в структуре образовательной программы	8
4. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся	9
5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий	11
5.1. Содержание дисциплины	11
5.2. Учебно-тематический план	14
5.3. Содержание семинаров, практических занятий	19
6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине	21
6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы	21
6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю	22
7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине	41
8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины	52
9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины	54
10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины	55
11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем	62
12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине	62

1. Наименование дисциплины

«Риск-менеджмент»

2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы с указанием индикаторов их достижения, соотнесенных с планируемыми результатами обучения по дисциплине

Таблица 1.1

Профиль «Логистика»

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции ¹	Результаты обучения (владения ² , умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции
ПKN-3	Способность применять инструменты прогнозирования, методы планирования и выработки управленческих решений, а также использовать способы обеспечения координации и контроля деятельности организации	1. Применяет методы анализа внутренней и внешней среды бизнеса, с определением зон конкурентного преимущества фирмы. 2. Использует методики расчета планов, программ и прогнозов на разных уровнях экономики с определением и оценкой их эффективности. 3. Работает с прогнозными документами и планами	Знать: методы сбора информации: наблюдений, обследований, опросов, опросов фокусных групп, сбора статистических данных и экспериментов. Уметь: определить тип необходимой информации; получить первичные данные; получить вторичные данные путем анализа отчетов компании, интервьюирования и анкетирования сотрудников и руководства компании. Знать: методы анализа и синтеза необходимой информации; методы контроля, мониторинга и прогнозирования рисков. Уметь: идентифицировать риски; использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; организовывать работу исполнителей для выполнения работ, в области менеджмента рисков. Знать: понятие риска и неопределённости; основные подходы к

¹ Заполняется при реализации актуализированных ОС ВО ФУ и ФГОС ВО 3++

² Владения формулируются только при реализации ОС ВО ФУ первого поколения и ФГОС ВО 3+

		организации, экономического развития отрасли, региона и экономики в целом.	классификации рисков; основные отечественные и зарубежные концепции менеджмента рисков; принципы управления рисками; методы нейтрализации риска. Уметь: идентифицировать, анализировать и оценивать риски предприятия; принимать решения на основе оценки рисков; вырабатывать антирисковые управляющие воздействия; снижать уровень риска до приемлемого уровня.
ПKN-7	Способность выявлять и реализовывать рыночные возможности, а также владеть навыками бизнес-планирования	1. Анализирует источники и выявляет предпринимательские возможности в условиях изменения внешней среды. 2. Владеет навыками реализации бизнес-идеи и формирования бизнес-моделей. 3. Владеет методиками анализа и расчета экономических и финансовых показателей и формирования бизнес-плана.	Знать: чистые и спекулятивные риски; финансовые риски; коммерческие риски; торговые и транспортные риски; операционные риски, страновые риски; Уметь: учитывать в предметной области чистые и спекулятивные риски; коммерческие риски; финансовые риски; торговые и транспортные риски; операционные риски; страновые риски. Знать: теоретические основы риск-менеджмента, основные понятия риск-менеджмента, а также основные стандарты в области управления рисками. Уметь: формировать культуру и инфраструктуру организации в области риск-менеджмента; выявлять основные факторы и причин возникновения рисков. Знать: методы вычисления чистых и спекулятивных рисков; финансовых рисков; коммерческих рисков; торговых и транспортных рисков; страновых рисков, операционных рисков. Уметь: выявлять риск и оценивать вероятность его реализации; определять масштаб последствий и максимально возможного убытка; применять рекомендации отечественных и мировых стандартов в области управления рисками.
ПКП-2	Способность решать	1. Применяет	Знать: способы анализа задач и

	логистические задачи на основе современных технологий управления	методы корректной постановки логистических задач	методов теории принятия решений и особенности принятия решений в управлении рисками; Уметь: принимать решения в области менеджмента рисков без использования численных значений вероятностей исходов, т. е. в условиях определенности.
		2. Использует современные технологии управления в качестве инструмента повышения эффективности логистической деятельности на предприятиях	Знать: понятие управленческого решения, количественные и качественные методы принятия управленческих решений, методы принятия решений в условиях риска и неопределённости; Уметь: принимать управленческие решения с использованием численных значений вероятностей исходов (т. е. в условиях неопределенности) и построения дерева управленческих решений.
		3. Демонстрирует навыки в получении и анализе информации, необходимой для решения логистических задач в условиях цифровой экономики	Знать: теоретические основы методов принятия управленческих решений в условиях риска и неопределённости. Уметь: использовать методы принятия управленческого решения, связанного с риском и неопределенностью в предметной области.

Таблица 1.2

Профиль «Финансовый менеджмент»

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции
ПKN-11	Способность анализировать рыночные и специфические риски при решении задач управления организацией	1.Использует знания инструментария риск-менеджмента для выявления факторов риска внешней и внутренней среды организации и обоснования измерения риска	Знать: чистые и спекулятивные риски; финансовые риски; коммерческие риски; торговые и транспортные риски; операционные риски, страновые риски. Уметь: учитывать в предметной области чистые и спекулятивные риски; коммерческие риски; финансовые риски; торговые и

		2.Проводит идентификацию рисков по функциям и направлениям деятельности организации. 3.Использует механизмы выявления причин, условий возникновения рисков с использованием методов количественной и качественной оценки рисков.	транспортные риски; операционные риски; страновые риски. Знать: теоретические основы риск-менеджмента, основные понятия риск-менеджмента, основные стандарты в области управления рисками. Уметь: формировать культуру и инфраструктуру организации в области риск-менеджмента; выявлять основные факторы и причин возникновения рисков. Знать: методы вычисления чистых и спекулятивных рисков; финансовых рисков; коммерческих рисков; торговых и транспортных рисков; страновых рисков, операционных рисков; Уметь: выявлять риск и оценивать вероятность его реализации; определять масштаб последствий и максимально возможного убытка; применять рекомендации отечественных и мировых стандартов в области управления рисками.
ПКП-3	Способность разрабатывать финансовую стратегию организации, долгосрочную и краткосрочную финансовую политику, а также принимать эффективные управленческие решения, обеспечивающие достижение стоящих перед организацией целей	1. Обладает навыками разработки финансовой стратегии и политики. 2. Использует современные методы и средства для принятия эффективных финансовых решений.	Знать: способы анализа задач и методов теории принятия решений и особенности принятия решений в управлении рисками; Уметь: принимать решения в области менеджмента рисков без использования численных значений вероятностей исходов, т.е. в условиях определенности; Знать: понятие управленческого решения, количественные и качественные методы принятия управленческих решений, методы принятия решений в условиях риска и неопределённости. Уметь: принимать управленческие решения с использованием численных значений вероятностей исходов (т. е. в условиях неопределенности) и

			построения дерева управленческих решений
ПКП-5	Способность реализовывать инвестиционные решения, осуществлять формирование и управление портфелем финансовых и реальных активов организации в целях максимизации ее стоимости	1. Владеет методами оценки инвестиций и активов организации 2. Применяет современные методы и модели управления инвестициями в целях максимизации стоимости бизнеса	Знать: методы сбора информации: наблюдений, обследований, опросов, опросов фокусных групп, сбора статистических данных и экспериментов. Уметь: определить тип необходимой информации; получить первичные данные; получить вторичные данные путем анализа отчетов компании, интервьюирования и анкетирования сотрудников и руководства компании. Знать: методы анализа и синтеза необходимой информации; методы контроля, мониторинга и прогнозирования рисков. Уметь: использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; организовывать работу исполнителей для выполнения работ, в области менеджмента рисков.

Таблица 1.3

Профиль «Менеджмент и управление бизнесом»

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (владения, умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции
ПКП-1	Способность планировать, организовывать и контролировать командную работу, вести деловые переговоры и реагировать на изменения	1. Демонстрирует владение методами планирования, организации и контроля командной работы	Знать: способы анализа задач и методов теории принятия решений и особенности принятия решений в управлении рисками; Уметь принимать решения в области менеджмента рисков без использования численных значений вероятностей исходов, т.е. в условиях определенности. Знать: понятие управленческого

		2. Применяет современные отечественные и зарубежные переговорные технологии в ходе деловых коммуникаций.	решения, количественные и качественные методы принятия управленческих решений, методы принятия решений в условиях риска и неопределённости; Уметь: принимать управленческие решения с использованием численных значений вероятностей исходов (т. е. в условиях неопределенности) и построения дерева управленческих решений.
ПКП-5	Способность оценивать риски и разрабатывать программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций	1. Демонстрирует навыки по оценке рисков и мониторинга деятельности компании. 2. Разрабатывает программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций.	Знать: методы сбора информации: наблюдений, обследований, опросов, опросов фокусных групп, сбора статистических данных и экспериментов. Уметь: определить тип необходимой информации; получить первичные данные; получить вторичные данные путем анализа отчетов компании, интервьюирования и анкетирования сотрудников и руководства компании. Знать: методы анализа и синтеза необходимой информации; методы контроля, мониторинга и прогнозирования рисков. Уметь: использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; организовывать работу исполнителей для выполнения работ, в области менеджмента рисков.

3. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к профилю и цикла профиля (элективный) по направлению подготовки 38.03.02 - Менеджмент, ОП "Финансовый менеджмент", Профиль: "Финансовый менеджмент", ОП "Управление бизнесом", Профиль: «Менеджмент и управление бизнесом», ОП "Логистика", Профиль: "Логистика".

4. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся

Таблица 2.1

Профиль: "Логистика" очная форма обучения

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр 6 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	3 з.е./108	108
<i>Контактная работа – Аудиторные занятия</i>	34	34
<i>Лекции</i>	16	16
<i>Семинары, практические занятия</i>	18	18
<i>Самостоятельная работа</i>	74	74
Вид текущего контроля	<i>Контрольная работа</i>	<i>Контрольная работа</i>
Вид промежуточной аттестации	<i>Зачет</i>	<i>Зачет</i>

Таблица 2.2

Профиль: "Финансовый менеджмент" очная форма обучения

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр 7 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	4 з.е./144	144
<i>Контактная работа – Аудиторные занятия</i>	50	50
<i>Лекции</i>	16	16
<i>Семинары, практические занятия</i>	34	34
<i>Самостоятельная работа</i>	94	94
Вид текущего контроля	<i>Контрольная работа</i>	<i>Контрольная работа</i>
Вид промежуточной аттестации	<i>Экзамен</i>	<i>Экзамен</i>

Профиль: "Финансовый менеджмент" очно-заочная форма обучения

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр 7 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	4 з.е./144	144
Контактная работа – Аудиторные занятия	34	34
<i>Лекции</i>	<i>16</i>	<i>16</i>
<i>Семинары, практические занятия</i>	<i>18</i>	<i>18</i>
Самостоятельная работа	110	110
Вид текущего контроля	<i>Контрольная работа</i>	<i>Контрольная работа</i>
Вид промежуточной аттестации	<i>Экзамен</i>	<i>Экзамен</i>

Таблица 2.3

Профиль: "Менеджмент и управление бизнесом" очная форма обучения

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр 7 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	4 з.е./144	144
Контактная работа – Аудиторные занятия	50	50
<i>Лекции</i>	<i>16</i>	<i>16</i>
<i>Семинары, практические занятия</i>	<i>34</i>	<i>34</i>
Самостоятельная работа	94	94
Вид текущего контроля	<i>Контрольная работа</i>	<i>Контрольная работа</i>
Вид промежуточной аттестации	<i>Экзамен</i>	<i>Экзамен</i>

Таблица 2.4

Профиль: "Менеджмент и управление бизнесом" очно-заочная форма обучения

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр 8 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	4 з.е./144	144
<i>Контактная работа – Аудиторные занятия</i>	32	32
<i>Лекции</i>	16	16
<i>Семинары, практические занятия</i>	16	16
<i>Самостоятельная работа</i>	112	112
Вид текущего контроля	<i>Контрольная работа</i>	<i>Контрольная работа</i>
Вид промежуточной аттестации	<i>Экзамен</i>	<i>Экзамен</i>

5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий

5.1. Содержание дисциплины

Тема 1. Риск и неопределенность

Основные подходы к рассмотрению неопределенности. Объект, его параметры и состояние. Внешняя среда организации. Влияние факторов внешней среды на состояние объекта. Теория вероятности о неопределенности. Детерминированные и стохастические факторы, влияющие на состояние объекта. Понятия стохастической и целевой неопределенности, причины возникновения данных видов неопределенности. Субъективная оценка состояния объекта, оценочные шкалы и их виды. Мера неопределенности объекта. Энтропия, как количественная мера неопределенности системы.

Риск и его сущность. Государственный стандарт о понятии риска. Мера риска. Последствия и вероятность, как способ измерения риска. Понятие объективной и субъективной вероятности. Структура реализации риска.

Тема 2. Риск и неопределённость. Классификация рисков.

Основания возникновения рисков. Чистые и спекулятивные риски. Торговые, производственные, имущественные, транспортные, политические, экологические, природные риски и причины их возникновения. Транспортные (логистические) риски и их классификация в соответствии с правилами международной торговой палаты Инкотермс.

Финансовые и коммерческие риски, как составная часть спекулятивных рисков. Риски связанные с покупательной способностью денег: инфляционные, дефляционные, валютные риски и риски ликвидности. Инвестиционные риски и их подвиды: риск упущенной выгоды, риск снижения доходности, риск прямых финансовых потерь, капитальный риск, страновой риск, временной риск. Кредитные риски и их классификация. Прочие виды рисков.

Тема 3. Управление риском

Эволюция отношения к риску в человеческом обществе. История возникновения менеджмента рисков. Переход от страхования рисков к их управлению. Показатель стоимостной оценки риска (VAR). Фрагментарная и интегрированная (корпоративная) модели управления риском. Современные концепции управления риском. Понятие риск-менеджмента. Парадигмы реализации риск-менеджмента «снизу вверх» и «сверху вниз». Жизненный цикл организации и выбор модели управления рисками. Управления рисками как процесс. Логическая схема построения и работы системы управления рисками. схема управления рисками (процесс РМ) по версии Федерации европейских ассоциаций риск-менеджеров (FERMA)

Тема 4. Оценка рисков

Идентификация риска, как процесс определения, составления перечня и описания элементов риска. Описание и источники риска. Организация и ее внутренняя и внешняя среда. Внутренние и внешние источники информации для идентификации рисков. Реестр (журнал) рисков и способы его создания. Руководство по созданию реестра риска организации Р 50.1.084 – 2011. Визуализация рисков: создание карты (матрицы) рисков.

Количественная оценка (измерение) риска. Дискретные и непрерывные модели риска. Распределения случайных величин, используемые при оценке рисков. Последствия и их числовые показатели. Числовые показатели последствий экономических рисков. Методы измерения риска: статистические, вероятностно-статистические, теоретико-вероятностные, экспертные. Концепция приемлемого риска, принцип ALARA/ALARP.

Тема 5. Методы обработки риска

Классификация методов обработки риска. Составление карты (матрицы) рисков. Приемлемые и неприемлемые риски. Методы перевода риска из неприемлемого в приемлемый: уклонение от риска (risk elimination, risk avoidance), уменьшение риска (risk reduction, risk mitigation), передача риска (risk transfer), удержание риска (risk retention). Регулирование и финансирование риска. Уклонение и уменьшение, как методы регулирования риска. Разделение и дублирование риска.

Понятие финансирования риска. Планируемые и случайные расходы по управлению риском. Классификация источников финансирования риска. Методы удержания (сохранения) и передачи (переноса) риска в целях финансирования. Осознанное и неосознанное удержание риска. Факторы влияющие на способность организации по удержанию риска. Передача риска, способы передачи риска: передача в целях регулирования риска; передача в целях финансирования риска. Механизмы передачи риска: передача риска по закону, передача риска по договору, др. механизмы передачи. Страхование, хеджирование риска.

Тема 6. Мониторинг и управление рисками

Управление рисками, как область стандартизации и средство повышения эффективности работы предприятия. Стандарты в риск-менеджменте. Понятие мониторинга рисков. Два основных типа стандартов управления рисками: стандарты оценки результатов и стандарты оценки деятельности. Разработка модели внутрифирменной системы риск-менеджмента. Понятие «политики управления рисками». Проверка соблюдения стандартов.

Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности, риска и неопределенности

Анализ задач и методов теории принятия решений, особенности принятия решений в управлении. Принятие решений без использования численных значений вероятностей исходов (в условиях определенности), принятие решений с использованием численных значений вероятностей исходов (в условиях неопределенности). Дерево управленческих решений.

5.2. Учебно – тематический план

Таблица 3.1

Профиль: "Логистика" очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (разделов) дисциплины	Трудоемкость в часах					Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Аудиторная работа			Самостоятель ная работа	
			Общая, вт.ч.:	Лекции	Семинары, практические занятия		
1.	Тема 1. Риск и неопределенность	18	5	3	3	10	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
2.	Тема 2. Риски и их классификация	15	5	3	3	10	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
3.	Тема 3. Управление риском	15	5	2	3	10	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
4.	Тема 4. Оценка рисков	15	5	2	3	10	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.

5.	Тема 5. Методы обработки риска	15	5	2	2	10	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
6.	Тема 6. Мониторинг и управление рисками	15	5	2	2	10	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
7.	Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и неопределенности	15	4	2	2	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
8.	В целом по дисциплине	108	34	16	18	74	Согласно учебному плану: Контрольная работа
9.	Итого в %	100	31	47	53	69	

Таблица 3.2

Профиль: "Финансовый менеджмент" очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (разделов) дисциплины	Трудоемкость в часах					Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Аудиторная работа			Самостоятель ная работа	
			Общая, вт.ч.:	Лекции	Семинары, практические занятия		
1.	Тема 1. Риск и неопределенность	20	8	3	5	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
2.	Тема 2. Риски и их классификация	20	8	3	5	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
3.	Тема 3. Управление риском	20	7	2	5	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
4.	Тема 4. Оценка рисков	20	7	2	5	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
5.	Тема 5. Методы обработки риска	20	7	2	5	12	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
6.	Тема 6. Мониторинг и управление рисками	20	7	2	5	12	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач.

							Тестирование.
7.	Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и неопределенности	24	6	2	5	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
8.	В целом по дисциплине	144	50	16	34	94	Согласно учебному плану: Контрольная работа
9.	Итого в %	100	35	32	31	69	

Профиль: "Финансовый менеджмент" очно-заочная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (разделов) дисциплины	Трудоемкость в часах					Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Аудиторная работа			Самостоятель ная работа	
			Общая, вт.ч.:	Лекции	Семинары, практические занятия		
10.	Тема 1. Риск и неопределенность	20	5	3	3	15	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
11.	Тема 2. Риски и их классификация	20	5	3	3	15	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
12.	Тема 3. Управление риском	20	5	2	3	15	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
13.	Тема 4. Оценка рисков	20	5	2	3	15	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
14.	Тема 5. Методы обработки риска	20	5	2	2	15	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
15.	Тема 6. Мониторинг и управление рисками	20	5	2	2	15	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
16.	Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и неопределенности	24	4	2	2	20	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
17.	В целом по	144	34	6	18	110	Согласно

	дисциплине						учебному плану: Контрольная работа
18.	Итого в %	100/100	35/24	32/47	31/53	69/76	

Таблица 3.3

Профиль: "Менеджмент и управление бизнесом" очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (разделов) дисциплины	Трудоемкость в часах					Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Аудиторная работа			Самостоятельная работа	
			Общая, вт.ч.:	Лекции	Семинары, практические занятия		
1.	Тема 1. Риск и неопределенность	20	8	3	5	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
2.	Тема 2. Риски и их классификация	20	8	3	5	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
3.	Тема 3. Управление риском	20	7	2	5	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
4.	Тема 4. Оценка рисков	20	7	2	5	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
5.	Тема 5. Методы обработки риска	20	7	2	5	12	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
6.	Тема 6. Мониторинг и управление рисками	20	7	2	5	12	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
7.	Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и неопределенности	24	6	2	4	14	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
8.	В целом по дисциплине	144	50	16	34	94	Согласно учебному плану: Контрольная работа
9.	Итого в %	100	35	32	68	65	

Таблица 3.4

Профиль: "Менеджмент и управление бизнесом" очно-заочная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (разделов) дисциплины	Трудоемкость в часах					Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Аудиторная работа			Самостоятельная работа	
			Общая, вт.ч.:	Лекции	Семинары, практические занятия		
1.	Тема 1. Риск и неопределенность	20	5	3	3	16	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
2.	Тема 2. Риски и их классификация	20	5	3	3	16	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
3.	Тема 3. Управление риском	20	4	2	2	16	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
4.	Тема 4. Оценка рисков	20	4	2	2	16	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
5.	Тема 5. Методы обработки риска	20	5	2	2	16	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
6.	Тема 6. Мониторинг и управление рисками	20	5	2	2	16	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
7.	Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и неопределенности	24	4	2	2	16	Дискуссия, разбор кейса. Решение задач. Тестирование.
8.	В целом по дисциплине	144	32	16	16	112	Согласно учебному плану: Контрольная работа
9.	Итого в %	100	22	50	50	78	

5.3. Содержание практических, семинарских занятий

Таблица 4

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов для обсуждения на семинарских, практических занятиях, рекомендуемые источники из разделов 8,9 (указывается раздел и порядковый номер источника)	Формы проведения занятий
Тема 1. Риск и неопределенность. Шкалы измерений параметров объектов.	1. Гост Р 51897-2011-2011 2. Понятие риска и неопределенности. 3. Способы измерения риска. 4. Понятия измерения и шкалирования. Классификация шкал по различным основаниям. 5. Изучение различных шкал измерения параметров объекта исследования. Непрерывные и дискретные шкалы измерений параметров. 6. Четыре основных типа шкал, которые можно применять для измерения параметров объектов: номинальная, порядковая, интервальная и шкала отношений. 7. Шкалы измерений параметров с точки зрения допустимых в них операций. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Дискуссия по теме. Групповое обсуждение тенденций и эволюции риск-менеджмента менеджменте. Решение практических заданий.
Тема 1. Риск и неопределенность. Мера неопределенности объекта.	1. Использование системного подхода для раскрытия понятия неопределенности объекта на примере свойства разнообразия системы, энтропия системы. 2. Понятие свойства разнообразия системы. Описание системы любой сложности с помощью переменных с альтернативной изменчивостью (например, изменчивостью типа 0 и 1). 3. Показатель степени неопределенности системы и его измерение. 4. Понятие энтропии. Энтропия как мера неопределенности системы. 5. Расчет энтропии системы с равновероятными состояниями. 6. Определения энтропии системы, вероятности состояний которой различны. 7. Энтропия и информация и их количественное измерение. Расчет прикладных задач на основе табличного процессора MS Excel. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов. Решение практических задач. Тестирование.
Тема 2. Классификация рисков.	1. Основные признаки классификации рисков. 2. Чистые и спекулятивные риски. 3. Производственные риски и причины их возникновения. 4. Транспортные риски и их сущность. 5. Операционные и технические риски.	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Разбор мини-кейсов. Решение тестов.

	6. Предпринимательские риски и их особенности. 7. Финансовые риски. Расчет финансовых рисков. 8. Прочие виды рисков. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2	
Тема 3. Управление риском	1. Эволюция отношения к риску. 2. Современные концепции риск-менеджмента и понятие менеджмента-риска. 3. Фрагментированная и модель управления рисками. Переход от фрагментированной к интегрированной модели управления рисками. Сравнение фрагментированной и интегрированной моделей управления рисками 4. Характеристики системы управления рисками на разных этапах жизненного цикла организации. 5. Процесс управления рисками. Общая схема управления рисками. Логическая схема построения и работы системы управления рисками. 6. Схема управления рисками (процесс РМ) по версии Федерации европейских ассоциаций риск-менеджеров (FERMA). 7. Схема итеративного процесса оценки риска и уменьшения риска, возникающего при использовании продукции, процессов или услуг (ГОСТ Р 51898-2002 «Аспекты безопасности. Правила включения в стандарты»)). Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов. Решение кейсов. Тестирование.
Тема 4. Оценка рисков	1. Процесс «Оценка риска». Риск и его идентификация. Составления перечня и описания элементов риска. 2. Описание риска. Понятия источника риска и события. 3. Подходы к идентификации рисков. Организация процесса идентификации рисков 4. Внутренние и внешние источники информации для идентификации рисков. Классификация источников. 5. Реестр рисков. Создание реестра рисков организации. 6. Изучение ключевых рисков организации и их основных факторов на примере конкретных обществ (ПАО, АО, ООО), в соответствии с рассмотренной классификацией с краткой общей характеристикой организации. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов. Решение кейсов. Тестирование.
Тема 5. Методы обработки риска	1. Измерение – количественная оценка риска. Дискретные и непрерывные модели риска. 2. Законы распределения случайных величин,	Фронтальный опрос студентов по теме занятия.

	используемые при оценке рисков. - Изучения равномерного закона распределения и его свойств на основе табличного процессора MS Excel - Изучения нормального закона распределения и его свойств на основе табличного процессора MS Excel. - Изучение биномиального закона распределения и его свойств на основе табличного процессора MS Excel. - Расчет практико-ориентированного задания по имитационному моделированию рисков проекта. - Методы обработки риска. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2	Изложение самостоятельно подготовленного материала с помощью мультимедийной презентации, обсуждение результатов. Решение кейсов. Тестирование.
Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и неопределенности	- Решение задач принятия решений без использования численных значений вероятностей исходов, с использованием вероятностей и по методу Парето. - Графическое отображение процесса принятия решений - дерево управленческих решений. - Расчет показателя VAR на основе табличного процессора MS Excel. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Решение кейсов и практических задач. Тестирование.

6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы

Таблица 5

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение	Формы внеаудиторной самостоятельной работы
Тема 1. Риск и неопределенность.	Энтропия, как мера неопределенности объекта. Шкалы измерения параметров. Основные типы шкал, применяемые для измерения параметров объектов: номинальная, порядковая, интервальная и шкала отношений. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2, 7	- работа с конспектом лекции; - работа с электронной библиотечной системой; - работа с информационно-образовательным порталом (ИОП) Фин. университета; - подготовка к тестированию; - подготовка к решению ситуационных задач; - подготовка к решению кейса.
Тема 2. Классификация	Транспортные (логистические) риски и их классификация в соответствии с	- работа с конспектом лекции; - работа с электронной

рисков.	правилами международной торговой палаты Инкотермс. Стратегические риски и стратегическая безопасность. SWOT-анализ, как метод снижения стратегических рисков. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 3	библиотечной системой; - работа с ИОП Фин. университета; - подготовка к тестированию; - подготовка к решению ситуационных задач; - подготовка к решению кейса.
Тема 3. Управление риском	Стандарты управления рисками FERMA. Итеративный процесс оценки риска и уменьшения риска, возникающего при использовании продукции, процессов или услуг (ГОСТ Р 51898-2002 «Аспекты безопасности. Правила включения в стандарты» вводится). Рекомендуемые источники: раздел 8 № 3,7	- работа с конспектом лекции; - работа с электронной библиотечной системой; - работа с ИОП Фин. университета; - подготовка к тестированию; - подготовка к решению ситуационных задач; - подготовка к решению кейса.
Тема 4. Оценка рисков	Инвестиции. Экономическая сущность инвестиций и их функции. Инвестиционные риски. Теоретические основы инвестиционных рисков. Оценка рисков инвестиционных проектов на предприятии. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 2, 5	- работа с конспектом лекции; - работа с электронной библиотечной системой; - работа с ИОП Фин. университета; - подготовка к тестированию; - подготовка к решению ситуационных задач; - подготовка к решению кейса.
Тема 5. Методы обработки риска	Страхование. Экономическая сущность страхования. Виды и функции страхования. Страхование, как способ передачи риска по договору страхования. Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1	- работа с конспектом лекции; - работа с электронной библиотечной системой; - работа с ИОП Фин. университета; - подготовка к тестированию; - подготовка к решению ситуационных задач; - подготовка к решению кейса.
Тема 6. Мониторинг и управление рисками	Управление рисками проекта. Анализ проблем проекта. Инструменты мониторинга рисков проекта. Разработка системы управления рисками проектов.	- работа с конспектом лекции; - работа с электронной библиотечной системой; - работа с ИОП Фин. университета; - подготовка к тестированию; - подготовка к решению ситуационных задач; - подготовка к решению кейса.
Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и	Управленческое решение и его сущность. Влияние риска на принятие управленческого решения.	- работа с конспектом лекции; - работа с электронной библиотечной системой; - работа с ИОП Фин.

неопределенности	Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1,2, 6	университета; - подготовка к тестированию; - подготовка к решению ситуационных задач; - подготовка к решению кейса.
------------------	--	---

6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю

Примерный перечень вопросов для промежуточного тестирования

Задание 1. Риски классифицируют по следующим совокупностям признаков:

- +: месту и времени возникновения рисков
- +: внешним и внутренним факторам, влияющим на их величину
- +: способам их анализа и методам воздействия на них
- : неустойчивости экономики и финансовой системы страны
- : физическому и моральному износу оборудования и основных фондов -: по вероятности потерь в результате изменения экономического состояния отрасли

Задание 2. В зависимости от результата возможного рискованного события риски подразделяют на ...

- +: чистые и спекулятивные
- : инфляционные и спекулятивные
- : инфляционные и дефляционные
- : естественные и искусственные
- : постоянные и временные -: статические и динамические

Задание 3. К чистым рискам относятся ...

- +: торговые
- +: производственные
- +: имущественные -: инфляционные
- : дефляционные
- : ликвидности

Задание 4. К спекулятивным рискам относятся ...

- : торговые
- : производственные
- : имущественные
- +: инфляционные
- +: дефляционные
- +: ликвидности

Задание 5. Инвестиционные риски относятся к ... riskам.

- + : торговым
- + : производственным
- + : чистым
- : инфляционным
- : дефляционным - :
- спекулятивным

Задание 6. Биржевые риски относятся к ... riskам.

- : торговым
- : производственным
- + : инвестиционным - :
- инфляционным
- : дефляционным
- : спекулятивным

Задание 7. Риск упущенной выгоды относится к ... riskам.

- : торговым
- : производственным
- + : инвестиционным - :
- инфляционным
- : дефляционным - :
- спекулятивным

Задание 8. Торговые риски относятся к ... riskам.

- + : инвестиционным
- + : производственным
- + : чистым
- : инфляционным
- : дефляционным - :
- спекулятивным

Задание 9. Риски, представляющие собой опасность потерь в процессе предпринимательской деятельности называются ...

- : инвестиционным
- : производственным
- + : коммерческими - :
- инфляционным
- : дефляционным
- : спекулятивным

Задание 10. Политические риски подразделяются на риски ...

- + : национализации
- + : трансферта
- + : разрыва контракта

- : инфляционные
- : дефляционные
- : инвестиционные

Задание 11. Согласно теории Ирвинга Фишера цены в стране растут ...

- +: с ростом денежной массы
- +: с увеличением скорости обращения денег
- : с увеличением объема всех товаров и услуг
- : с уменьшением денежной массы
- : с уменьшением скорости обращения денег
- +: с уменьшением объема всех товаров и услуг

Задание 12. Инфляция в январе составила 2%, в феврале – 3% и в марте – 1%.

Инфляция в первом квартале равна...

- +: 6,11%
- : 6,00%
- : 5,96%
- : 6,05%
- : 6,50%
- : 6,60%

Задание 13. Инфляция в первом квартале составила 2%, во втором – 3%, в третьем –

1% и в четвертом – 2%. Годовая инфляция равна...

- +: 8,23%
- : 8,00%
- : 7,96%
- : 8,07%
- : 8,50%
- : 12,0%

Задание 14. Возникновение или изменение специфического набора условий в соответствии с ГОСТ Р 51897-2011 – это ...

*событие

Задание 15. Общепринятый числовой показатель последствий Value-at-Risk (VaR) имеет российской обозначение ...

*сумма под риском

максимально возможный риск

ожидаемый риск

прогнозируемый риск

наиболее вероятный риск

неизбежный риск

минимально возможный риск

Задание 16. Ущерб, соответствующий полному уничтожению (утрате) объекта – это ...

*максимально возможный убыток

сумма под риском

максимально возможный риск

ожидаемый убыток

прогнозируемый риск

наиболее вероятный убыток

минимально возможный риск

Задание 17.

Моде **Mo** распределения случайной величины с точки зрения теории вероятностей соответствует ...

*наиболее вероятный убыток

максимально возможный убыток

сумма под риском

минимально возможный убыток

ожидаемый убыток

прогнозируемый убыток

Задание 18. Форма записи информации об идентифицированном риске – это ...

*реестр риска

Примерные задания для обсуждений:

Кейс «Анализ деятельности компании

ПАО «Авиационная холдинговая компания «Сухой»

История Публичного Акционерного Общества «ОКБ Сухого» берет свое начало с бригады №4 АГОС ЦАГИ, которую в октябре 1930 г. возглавил Павел Осипович Сухой. Именно с этого момента начинается формирование конструкторского коллектива будущего ОКБ. В последующие годы КБ Сухого занимало одно из ведущих мест в советском авиастроении. Достаточно вспомнить такие легендарные самолеты, как фронтовой бомбардировщик Су24 с крылом изменяемой стреловидности, первый отечественный серийный реактивный штурмовик Су-25 (1975 г.), который находится на вооружении ВВС РФ до сих пор, семейство самолетов Су-27 (1977 г.) и другие самолеты на его базе (Су-30, Су-32, Су-33).

Однако, начиная с 1991 г., КБ Сухого (в то время АНПК «ОКБ Сухого»), как значительная часть российского ВПК, переживает не лучшие времена. Период, начиная с 1991 г., характеризовался резким спадом производства авиационной техники, что объяснялось, помимо общего спада промышленного производства, сокращением военного заказа более чем в 10 раз, снижением, а с 1994 г. – прекращением бюджетного финансирования закупок гражданской авиатехники, прекращением с 1996 г. закупок военной авиатехники, существенным уменьшением платежеспособного спроса российских

авиакомпаний, сокращением их пассажирооборота. К 1998 г. спад достиг нижней точки – около 20% от объема продукции в 1991 г. Производство гражданских самолетов сократилось в 12, а вертолетов – в 8 раз. В 1998 г. в основном за счет экспортных поставок военной авиатехники и вертолетов начался рост производства.

В начале 1990-х годов, когда производство военных самолетов сокращается, в КБ начинаются работы по гражданской тематике. Начинаются разработки грузопассажирского самолета Су-80ГП и сельскохозяйственного Су-38Л. Однако создание такой сложной и наукоемкой продукции, как самолет (в независимости от его назначения), требует достаточного количества времени и инвестиций. В целом можно говорить, что эти проекты были рассчитаны на перспективу.

После кризиса 1998 г. для компании начинаются «новые времена», в первую очередь, связанные с коренной модернизацией. Новым генеральным директором компании стал Михаил Асланович Погосян, работавший в КБ «Сухой» с 1979 г., а в период с 1992 по 1998 г. – заместителем генерального конструктора.

В 2002 г. в компании начинается реорганизация управления проектами. В том же 2002 г. сменилось руководство ОКБ «Сухого», пришла более молодая команда менеджеров, и началась работа по определению требований к новой информационной системе управления (ИСУ) предприятия и ее основной подсистемы управления проектами. К этому времени в конструкторских подразделениях используются современные информационные системы класса САПР и CALS.

В сентябре 2003 г. государственное унитарное предприятие «Авиационный военно-промышленный комплекс «Сухой» было преобразовано в ОАО «Авиационная холдинговая компания «Сухой».

{В настоящий момент в состав холдинга ПАО «Авиационная холдинговая компания «Сухой» входят:

Головной компанией холдинга является ПАО «Компания «Сухой», которой принадлежат:

- 50 % + 23 акции ПАО «ОКБ Сухого»
- 75,23 % ПАО «КнААПО им. Ю. А. Гагарина» (Комсомольск-на-Амуре)
- 78,32 % ПАО НАЗ им. В.П. Чкалова (Новосибирск)
- 71,99 % АО «Гражданские самолеты Сухого»
- 9,97 % ПАО «Корпорация, Иркутск» (Иркутск)
- 30,39 % ПАО «ТАНТК им. Г. М. Бериева» (Таганрог)}.

Главной целью холдинга «Сухой» становится формирование и стабильное развитие экономической эффективной и высокотехнологичной авиастроительной компании мирового уровня.

Дальнейшее развитие холдинга предполагает выделение целей по срокам реализации:

1) краткосрочные цели (2003-2005 гг.): сохранение и развитие накопленного разработчиками и серийными заводами научно-технического и производственного потенциала для эффективной реализации заключенных контрактов;

2) среднесрочные цели (2006-2010 гг.): удержание конкурентных позиций на рынке авиационной техники за счет создания и реализации новых истребителей типа Су-32, Су-35, гражданских самолетов Sukhoi SuperJet 100 и самолетов общего назначения, освоения новых видов послепродажных услуг;

3) долгосрочные цели (2011-2016 гг.): выход на новые рынки авиационной техники за счет реализации программ создания самолетов нового поколения (пятого) фронтовой авиации (ПАК ФА Т-50), гражданской авиации и беспилотных летательных аппаратов в кооперации с российскими и зарубежными партнерами, а также дальнейшего развития послепродажных услуг.

Следует отметить, что по отношению к 1991 г. в 2000 г. объем выпускаемой продукции авиапромышленного комплекса составил около 35% (в сопоставимых ценах). При этом, в этот период объем производства снижался быстрее, чем численность работников, что привело к падению производительности труда в 2,5 – 3 раза.

В 2001 г. прирост валовой продукции составил 42,2%, а в 2002 – 26,7%. Государственный заказ на основные виды авиационной техники и вооружения обеспечивает загрузку производственных мощностей лишь на 10 – 15%. С учетом других заказов в среднем производственные мощности загружены на 25 – 30%, что сильно удорожает себестоимость продукции.

В этот период «АХК «Сухой» начинает активно действовать на международном рынке, постепенно увеличивая экспорт своей продукции за рубеж. В целом за период с 2001 по 2006 г. объем экспортных поставок увеличился до 272 самолетов. В 2007 г. компания реализовала на рынке вооружений продукцию на сумму свыше 1,5 млрд. долларов, в том числе более 30 боевых самолетов. Самолеты Су-30 поставляются в Малайзию, Алжир и Венесуэлу, а самолето-комплекты для лицензионного производства Су30МКИ – в Индию. Таким образом, компания впервые подошла к экспортному порогу в 300 истребителей типа Су-30МКИ.

Однако компании пришлось столкнуться с конкуренцией со стороны других авиапроизводителей. Главными конкурентами компании выступают американская компания Lockheed Martin Corporation, (самолеты: F-15, F-16, F18, F-22, F-35), французская Dassault Aviation (модель «Мираж»), европейская Eurofighter Gmbh (модель «Тайфун»). Кроме того, деятельность компании также ограничивается представителями государственных структур других государств. Так, В августе 2006 Государственный департамент США ввёл санкции против российских государственных компаний «Рособоронэкспорт» и «Сухой». Их обвиняют в нарушении закона «О нераспространении в отношении Ирана» от 2000 года, которым запрещается сотрудничество с Ираном в сфере распространения оружия массового поражения. Введёнными санкциями запрещается американским государственным органам покупать или продавать какие-либо товары, пользоваться или оказывать услуги этим компаниям. В конце июля 2006 «Рособоронэкспорт» заключил контракт на модернизацию 30 фронтовых бомбардировщиков Су-24 ВВС Ирана, которые теоретически могут быть носителями тактического ядерного оружия. Контракт исполняла компания «Сухой».

Сегодня ПАО «Компания «Сухой» – крупнейший российский авиационный производитель с общей численностью персонала – около 31 тыс. человек. Выручка компании в 2008 году составила 38,77 млрд руб. (рост 15,5 %, в 2007 году – 33,574 млрд руб.). Чистый убыток за 2008 – 1,585 млрд руб. (в 2007 году чистая прибыль – 3,125 млрд руб.).

В период с 2008 по 2015 год компания «Сухой» занимает первое место в мире по экспорту новых истребителей по количеству заказанных самолётов (280 единиц). В денежном выражении компания в этом периоде занимает третье место с показателем \$12,73 млрд., уступая «Локхид Мартин» (\$15,65 млрд.) и «Боингу» (\$13,3 млрд.).

«Сухой» занимает 15,2% в денежном и 19,9% в количественном выражении мирового экспорта новых многофункциональных истребителей с 2012 по 2015 год.

Задание

1. Дайте краткую характеристику предлагаемой организации.
2. Выделите и рассмотрите внутренние факторы организации. Проведите количественную оценку сильных и слабых сторон ПАО «АХК Сухой».
3. Выделите и рассмотрите внешние факторы организации. Проведите количественную оценку возможностей и угроз, исходящих от внешней среды ПАО «АХК Сухой».
4. Проведите SWOT-анализ организации.
5. Составьте матрицу угроз компании ПАО «АХК Сухой».

6. Приведите возможные ключевые риски и их основные факторы на примере ПАО «АХК Сухой».

***Применение метода Монте-Карло при анализе привлекательности
инвестиционного проекта***

Описание проекта

Фармацевтическая компания рассматривает вопрос о приобретении для последующего производства патента нового лекарственного препарата. Лекарство примечательно тем, что не имеет побочных эффектов. Стоимость патента составляет N млн. руб. Необходимо подготовить финансовый анализ приобретения данного патента методом дисконтированных денежных потоков, рассчитать среднюю величину ЧПС проекта и найти вероятность (риск) того, что ЧПС примет отрицательное значение. Горизонт расчетов составляет три года. Стандартная финансовая модель дана в табличном виде. Согласно прогнозам аналитиков, компания в первый, второй и третий год проекта продаст соответственно x , y и z упаковок лекарства по цене c_1 , c_2 и c_3 за упаковку.

Ставка налога на прибыль равна $a\%$, ставка дисконтирования равна $b\%$, себестоимость составляет $d\%$, а операционные издержки – $f\%$ от цены препарата.

Задание

Рассчитайте экономическую эффективность проекта и вероятность получения отрицательного ЧПС с учетом следующих факторов неопределенности, последовательно включая их в анализ:

- цена упаковки препарата подчиняется треугольному распределению с параметрами минимальное значение – $\min$, максимальное значение – $\max$, наиболее вероятное значение – A .
- объем продаж подчиняется нормальному распределению со средним значением $aver$ и стандартным отклонением σ .

оцените влияние на эффективность и риск проекта заключение компанией форвардного контракта на продажу N_1 упаковок препарата в каждый из 3 последующих лет по цене c_4 за упаковку (предположим, что стоимость заключения такого контракта равна 0). Как изменяться показатели проекта, если компания купит опцион на продажу N_1 упаковок препарата в каждый из 3 последующих лет по цене c_4 за упаковку и какова максимальная стоимость такого опциона, которую будет готова заплатить компания.

Примеры заданий для дискуссий:

Задание 1.

С каким риском сталкивается автолюбитель, приобретающий автомобиль стоимостью 20 000 евро и имеющий привычку менять автомобиль каждые три года, если стоимость аренды автомобиля составляет 4000 евро в год, а банковская процентная ставка равна 10%. Как можно этим риском управлять?

Задание 2.

Оцените валютные риски компании ПАО «Новинтех» занимающейся продажей российского программного продукта за рубежом. Условие кейса представлено ниже.

Предполагается поместить 12000 долларов США на рублевом депозите. Курс обмена валюты на начало операции 66,88 рублей за доллар, а прогнозируемый курс на конец операции – 68,15 руб./\$. Процентные ставки равны: в рублях 9%, а в долларах США 5%. Срок депозита 3 месяца. Определить наращенную сумму в \$ к концу операции. Оценить доходность операции.

Задание 3.

Оцените валютные риски компании ПАО «Kaspersky» занимающейся продажей антивирусного программного продукта. Условие кейса представлено ниже.

Предполагается поместить 2 000 000 рублей на валютном депозите. Курс обмена валюты на начало операции 65,56 рублей за доллар, а прогнозируемый курс на конец операции – 67,38 руб./\$. Процентные ставки равны: в рублях 9%, а в долларах США 5%. Срок депозита 5 месяцев. Определить наращенную сумму в рублях к концу операции. Оценить доходность операции.

Задание 4.

Оцените валютные риски компании ПАО «Автоваз» осуществляющей выпуск и оптовую продажу автомобилей. Условие кейса представлено ниже.

Предполагается поместить 9 280 000 рублей на валютном депозите. Курс обмена валюты на начало операции 76,01 рублей за евро, а прогнозируемый курс на конец операции – 77,64 руб./евро. Процентные ставки равны: в рублях 9%, а в

евро 4,3%. Срок депозита 10 месяцев. Определить наращенную сумму в рублях к концу операции. Оценить доходность операции.

Задание 5.

Оцените валютные риски компании ПАО «Компас» осуществляющую экспорт драг. металла за рубеж. Условие кейса представлено ниже.

Компания ПАО «Компас» закупила товар на сумму в 100 млн. руб., который реализовала в виде экспортной поставки за 3,8 млн. долларов США. Какова эффективность этой операции, если операция заняла две недели, таможенная пошлина составила 10% от валютной выручки, курс покупки долларов банком в конце операции равнялся 66,89 руб. за доллар США. Временная база 365.

Задание 6.

Оцените валютные риски компании ПАО «Антал» собирающейся инвестировать средства в валютные активы. Условие кейса представлено ниже.

Если курс доллара США к российскому рублю равен 58,49 руб. /долл., простая процентная ставка для долларовых инвестиций составляет 6% годовых, а для рублевых – 8%, то каков должен быть обменный курс доллара к рублю через год, чтобы рублевые инвестиции в американские активы вышли на уровень безубыточности?

Задание 7.

Оцените валютные риски российской компании собирающейся инвестировать средства в валютные активы. Условие кейса представлено ниже.

Если курс доллара США к российскому рублю равен 59,13 руб. /долл., простая процентная ставка для долларовых инвестиций составляет 6,5% годовых, а для рублевых – 8,5%, то каков должен быть обменный курс доллара к рублю через год, чтобы рублевые инвестиции в американские активы превысили уровень безубыточности на 3%?

Примерные варианты заданий контрольной работы

Вариант выбирается в соответствии с последней цифрой идентификационного номера студента.

Вариант 1

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таблице 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы	a	b	c	d
A	0,125	0,125	0,125	0,125
B	0,125	0,125	0,125	0,125

2. Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние d , то какова максимальная энтропия новой системы?
3. Если система включает четыре переменные X_1 , X_2 , X_3 и X_4 каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
4. Если система включает сем переменные X_1 , X_2 , X_3 , X_4 ... X_7 каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние a_2 ?

Таблица 2

a_i	a_1	a_2	a_3	a_4
p_i	0,1	0,2	0,3	0,4

Вариант 2

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таблице 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы	a	b	c	d	e
A	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1
B	0,1	0,1	0,1	0,1	0,1

2. Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние c , то какова максимальная энтропия новой системы?
3. Если система включает три переменные X_1 , X_2 , X_3 каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?

4. Если система включает шесть переменных $X_1, X_2, X_3, X_4 \dots X_6$ каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние a_2 ?

Таблица 2

a_i	a_1	a_2	a_3	a_4
p_i	0,2	0,3	0,3	0,2

Вариант 3

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таб. 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы	a	b	c
A	0,1667	0,1667	0,1667
B	0,1667	0,1667	0,1667

2. Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние a , то какова максимальная энтропия новой системы?
3. Если система включает пять переменных X_1, X_2, X_3, X_4, X_5 , каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
4. Если система включает три переменные X_1, X_2, X_3 , каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние a_3 ?

Таблица 2

a_i	a_1	a_2	a_3	a_4
p_i	0,2	0,2	0,4	0,2

Вариант 4

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таб. 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы	<i>a</i>	<i>b</i>	<i>c</i>	<i>d</i>	<i>e</i>	<i>f</i>
<i>A</i>	0,0833	0,0833	0,0833	0,0833	0,0833	0,0833
<i>B</i>	0,0833	0,0833	0,0833	0,0833	0,0833	0,0833

2. Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние ***B***, то какова максимальная энтропия новой системы?
3. Если система включает восемь переменных $X_1, X_2, X_3 \dots X_8$ каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
4. Если система включает семь переменных $X_1, X_2, X_3, X_4 \dots X_7$ каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние ***a*₅**?

Таблица 2

a_i	<i>a</i> ₁	<i>a</i> ₂	<i>a</i> ₃	<i>a</i> ₄	<i>a</i> ₅
<i>P_i</i>	0,1	0,2	0,1	0,2	0,4

Вариант 5

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таб. 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы	<i>a</i>	<i>b</i>	<i>c</i>	<i>d</i>	<i>e</i>	<i>f</i>	<i>g</i>
<i>A</i>	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714
<i>B</i>	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714

2. Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние ***g***, то какова максимальная энтропия новой системы?

3. Если система включает семь переменных $X_1, X_2, X_3, \dots, X_7$ каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
4. Если система включает восемь переменных $X_1, X_2, X_3, X_4, \dots, X_8$ каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние **AB**?

Таблица 2

Возможные состояния системы		<i>C</i>		<i>D</i>		<i>E</i>		<i>F</i>	
		<i>CB</i>	<i>CM</i>	<i>DB</i>	<i>DM</i>	<i>EB</i>	<i>EM</i>	<i>FB</i>	<i>FM</i>
<i>A</i>	<i>AB</i>	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125
	<i>AM</i>	0,125	0,075	0,125	0,125	0,125	0,125	0,025	0,025

Вариант 6

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таб. 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы	<i>a</i>	<i>b</i>	<i>c</i>	<i>d</i>	<i>e</i>	<i>f</i>	<i>g</i>
<i>A</i>	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714
<i>B</i>	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714	0,0714

2. Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние **A**, то какова максимальная энтропия новой системы?
3. Если система включает четыре переменные X_1, X_2, X_3, X_4 каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
4. Если система включает шесть переменных $X_1, X_2, X_3, X_4, \dots, X_6$ каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением

вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние a_5 ?

Таблица 2

a_i	a_1	a_2	a_3	a_4	a_5	a_6
P_i	0,1	0,2	0,1	0,2	0,3	0,1

Вариант 7

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таб. 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы		C		D		E		F	
		CB	CM	DB	DM	EB	EM	FB	FM
A	AB	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625
	AM	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625

2. Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние **AB**, то какова максимальная энтропия новой системы?
3. Если система включает десять переменных $X_1, X_2, X_3 \dots X_{10}$ каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
4. Если система включает пять переменных $X_1, X_2, X_3, X_4 \dots X_5$ каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние a_5 ?

Таблица 2

Возможные состояния системы		C		D		E		F	
		CB	CM	DB	DM	EB	EM	FB	FM
A	AB	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125
	AM	0,125	0,075	0,125	0,125	0,125	0,125	0,025	0,025

Вариант 8

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таб. 1.

Таблица 1

Возможные	C	D	E	F
-----------	-----	-----	-----	-----

состояния системы		<i>CB</i>	<i>CM</i>	<i>DB</i>	<i>DM</i>	<i>EB</i>	<i>EM</i>	<i>FB</i>	<i>FM</i>
A	AB	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625
	AM	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625

- Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние **D**, то какова максимальная энтропия новой системы?
- Если система включает десять переменных $X_1, X_2, X_3 \dots X_{10}$ каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
- Если система включает пять переменных $X_1, X_2, X_3, X_4 \dots X_5$ каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
- Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние a_5 ?

Таблица 2

a_i	a_1	a_2	a_3	a_4	a_5
P_i	0,1	0,2	0,1	0,2	0,4

Вариант 9

- Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таб. 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы	<i>C</i>		<i>D</i>		<i>E</i>		<i>F</i>	
	<i>CB</i>	<i>CM</i>	<i>DB</i>	<i>DM</i>	<i>EB</i>	<i>EM</i>	<i>FB</i>	<i>FM</i>
A	0,125	0,125	0,125	0,125	0,125	0,125	0,125	0,125

- Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние **D**, то какова максимальная энтропия новой системы?
- Если система может находиться с одинаковыми вероятностями в четырех состояниях, то, чему равна максимальная энтропия этой системы?

4. Если система включает десять переменных $X_1, X_2, X_3, X_4 \dots X_{10}$ каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние **DB**?

Таблица 2

Возможные состояния системы		C		D		E		F	
		CB	CM	DB	DM	EB	EM	FB	FM
A	AB	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125	0,03125
	AM	0,125	0,075	0,125	0,125	0,125	0,125	0,025	0,025

Вариант 10

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таблице 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы		C		D		E		F	
		CB	CM	DB	DM	EB	EM	FB	FM
A	AB	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625
	AM	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625	0,0625

2. Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние **C**, то какова максимальная энтропия новой системы?
3. Если система включает двенадцать переменных $X_1, X_2, X_3 \dots X_{12}$ каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
4. Если система может находиться с одинаковыми вероятностями в четырех состояниях, то, чему равна максимальная энтропия этой системы?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние **CM**?

Таблица 2

Возможные состояния системы		C		D		E		F	
		CB	CM	DB	DM	EB	EM	FB	FM
A	AB	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125
	AM	0,135	0,085	0,135	0,135	0,135	0,135	0,035	0,035

Вариант 11

1. Рассчитайте максимальную энтропию системы, представленную в таб. 1.

Таблица 1

Возможные состояния системы	a	b	c	d
A	0,04	0,15	0,16	0,14
B	0,11	0,12	0,18	0,1

2. Если система, показанная в таблице 1, пришла в состояние C, то какова максимальная энтропия новой системы?
3. Если система включает шесть переменных $X_1, X_2, X_3, \dots, X_6$ каждая из которых может находиться только в двух возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
4. Если система включает шесть переменных $X_1, X_2, X_3, X_4, \dots, X_6$ каждая из которых может находиться только в трех возможных состояниях, то, сколько возможных состояний имеет система?
5. Чему равна энтропия системы, представленной в таблице 2, состояние которой описывается дискретной величиной со следующим распределением вероятностей состояний. Чему равна энтропия система перешедшей в состояние AB?

Таблица 2

Возможные состояния системы		C		D		E		F	
		CB	CM	DB	DM	EB	EM	FB	FM
A	AB	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125	0,02125
	AM	0,135	0,085	0,135	0,135	0,135	0,135	0,035	0,035

Критерии балльной оценки различных форм текущего контроля успеваемости содержатся в соответствующих методических рекомендациях Департамента менеджмента и инноваций.

7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Перечень компетенций с указанием индикаторов их достижения в процессе освоения образовательной программы содержится в разделе 2 «Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы с указанием индикаторов их достижения, соотнесенных с планируемыми результатами обучения по дисциплине».

Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки индикаторов достижения компетенций, умений и знаний, представлены в таблице 7.

Профиль «Логистика»

Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (умения и знания), соотнесенные с индикаторами достижения компетенции	Типовые контрольные задания
ПKN-3 Способность применять инструменты прогнозирования, методы планирования и выработки управленческих решений, а также использовать способы обеспечения координации и контроля деятельности организации	1. Применяет методы анализа внутренней и внешней среды бизнеса, с определением зон конкурентного преимущества фирмы. 2.Использует методики расчета планов, программ и прогнозов на разных уровнях экономики с определением и оценкой их эффективности. 3.Работает с	Знать: методы сбора информации: наблюдений, обследований, опросов, опросов фокусных групп, сбора статистических данных и экспериментов. Уметь: определить тип необходимой информации; получить первичные данные; получить вторичные данные путем анализа отчетов компании, интервьюирования и анкетирования сотрудников и руководства компании. Знать: методы анализа и синтеза необходимой информации; методы контроля, мониторинга и прогнозирования рисков. Уметь: идентифицировать риски; использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; организовывать работу исполнителей для выполнения работ, в области менеджмента рисков. Знать: понятие риска и	1. Соберите всю необходимую информацию и проведите PEST-анализ экономического положения компании ПАО «Газпром» 2. На основе данных PEST-анализа проведите SWOT-анализ для компании ПАО «Газпром» 3. На основе полученных результатов PEST- и SWOT-анализа составьте реестр рисков компании ПАО «Газпром» 4. Торговый агент предлагает предприятиям новый продукт. Из предыдущего опыта ему известно, что в среднем 1 из 65

	прогнозами документами и планами организации, экономического развития отрасли, региона и экономики в целом.	неопределённости; основные подходы к классификации рисков; основные отечественные и зарубежные концепции менеджмента рисков; принципы управления рисками; методы нейтрализации риска. Уметь: идентифицировать, анализировать и оценивать риски предприятия; принимать решения на основе оценки рисков; вырабатывать антирисковые управляющие воздействия; снижать уровень риска до приемлемого уровня.	клиентов, которым он предлагает товар, покупает его. В течение некоторого промежутка времени он предложил продукт 20 предприятиям. Чему равна вероятность того, что он продаст им хотя бы единицу товара?
ПКН-7 Способность выявлять и реализовывать рыночные возможности, а также владеть навыками бизнес-планирования	1. Анализирует источники и выявляет предпринимательские возможности в условиях изменения внешней среды. 2. Владеет навыками реализации бизнес-идеи и формирования бизнес-моделей. 3. Владеет методиками анализа и расчета экономических и финансовых показателей и формирования бизнес-плана.	Знать: чистые и спекулятивные риски; финансовые риски; коммерческие риски; торговые и транспортные риски; операционные риски, страновые риски; Уметь: учитывать в предметной области чистые и спекулятивные риски; коммерческие риски; финансовые риски; торговые и транспортные риски; операционные риски; страновые риски. Знать: теоретические основы риск-менеджмента, основные понятия риск-менеджмента, а также основные стандарты в области управления рисками. Уметь: формировать культуру и инфраструктуру организации в области риск-менеджмента; выявлять основные факторы и причин возникновения рисков. Знать: методы вычисления чистых и спекулятивных рисков; финансовых рисков; коммерческих рисков; торговых и транспортных рисков; страновых рисков, операционных рисков. Уметь: выявлять риск и оценивать вероятность его реализации; определять масштаб последствий и максимально возможного убытка; применять рекомендации отечественных и мировых	1. На основе изученного теоретического материала и данных проведения PEST- и SWOT-анализа составьте классификацию рисков компании ПАО «Газпром» 2. Оцените валютные риски компании ПАО «Kaspersky» занимающейся продажей антивирусного программного продукта. Условие кейса представлено ниже. Предполагается поместить 2 000 000 рублей на валютном депозите. Курс обмена валюты на начало операции 65,56 рублей за доллар, а прогнозируемый курс на конец операции – 67,38 руб./\$. Процентные ставки равны: в рублях 9%, а в долларах США 5%. Срок депозита 5 месяцев. Определить

		стандартов в области управления рисками.	наращенную сумму в рублях к концу операции. Оценить доходность операции. 3. Оцените валютные риски компании ПАО «Компас» осуществляющую экспорт драг. металла за рубеж. Условие кейса представлено ниже. Компания ПАО «Компас» закупила товар на сумму в 100 млн. руб., который реализовала в виде экспортной поставки за 3,8 млн. долларов США. Какова эффективность этой операции, если операция заняла две недели, таможенная пошлина составила 10% от валютной выручки, курс покупки долларов банком в конце операции равнялся 66,89 руб. за доллар США. Временная база 365.
ПКП-2 Способность решать логистические задачи на основе современных технологий управления	1 Применяет методы корректной постановки логистических задач 2.Использует современные технологии управления в качестве инструмента повышения эффективности логистической	Знать: способы анализа задач и методов теории принятия решений и особенности принятия решений в управлении рисками; Уметь: принимать решения в области менеджмента рисков без использования численных значений вероятностей исходов, т. е. в условиях определенности. Знать: понятие управленческого решения, количественные и качественные методы принятия управленческих решений, методы принятия решений в условиях риска и неопределённости; Уметь: принимать управленческие решения с использованием численных значений вероятностей исходов (т.	1. С каким риском сталкивается автолюбитель, приобретающий автомобиль стоимостью 20 000 евро и имеющий привычку менять автомобиль каждые три года, если стоимость аренды автомобиля составляет 4000 евро в год, а банковская процентная ставка равна 10%. Как можно этим риском управлять? 2. Постройте экономико-математическую

	деятельности на предприятиях 3. Демонстрирует навыки в получении и анализе информации, необходимой для решения логистических задач в условиях цифровой экономики	е. в условиях неопределенности) и построения дерева управленческих решений. Знать: теоретические основы методов принятия управленческих решений в условиях риска и неопределённости. Уметь: использовать методы принятия управленческого решения, связанного с риском и неопределенностью в предметной области.	модель следующей задачи. Имеются три поставщика и четыре потребителя. Мощность поставщиков и спросы потребителей, а также затраты на перевозку единицы груза для каждой пары "поставщик — потребитель" сведены в таблицу поставок. Учтите риск того, что возможны дорожные работы на пути от 2-го поставщика к 4-му потребителю. 1. Инвестор планирует вложить средства в мясоперерабатывающие предприятия А и Б. Надежность первого оценивается экспертами на уровне 70 %, а второго – 85 %. Чему равна вероятность того, что: а) оба предприятия в течение года не станут банкротами? б) наступит хотя бы одно банкротство?
--	--	--	---

Таблица 7.2

Профиль «Финансовый менеджмент»

Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (умения и знания), соотнесенные с индикаторами достижения компетенции	Типовые контрольные задания
ПKN-11 Способность анализировать рыночные и специфические риски при решении задач	1. Обладает теоретическими основами классификации рисков.	Знать: чистые и спекулятивные риски; финансовые риски; коммерческие риски; торговые и транспортные риски; операционные риски,	1. На основе изученного теоретического материала и данных проведения PEST- и SWOT-анализа составьте классификацию рисков компании ПАО «Газпром»

управления организацией	2. Умеет применять теоретические основы риск-менеджмента на практике. 3. Владеет методами оценки и оценивания рисков	страновые риски. Уметь: учитывать в предметной области чистые и спекулятивные риски; коммерческие риски; финансовые риски; торговые и транспортные риски; операционные риски; страновые риски. Знать: теоретические основы риск-менеджмента, основные понятия риск-менеджмента, основные стандарты в области управления рисками. Уметь: формировать культуру и инфраструктуру организации в области риск-менеджмента; выявлять основные факторы и причин возникновения рисков. Знать: методы вычисления чистых и спекулятивных рисков; финансовых рисков; коммерческих рисков; торговых и транспортных рисков; страновых рисков, операционных рисков; Уметь: выявлять риск и оценивать вероятность его реализации; определять масштаб последствий и максимально возможного убытка; применять рекомендации отечественных и мировых стандартов в области управления рисками.	2. Оцените валютные риски компании ПАО «Kaspersky» занимающейся продажей антивирусного программного продукта. Условие кейса представлено ниже. Предполагается поместить 2 000 000 рублей на валютном депозите. Курс обмена валюты на начало операции 65,56 рублей за доллар, а прогнозируемый курс на конец операции – 67,38 руб./\$. Процентные ставки равны: в рублях 9%, а в долларах США 5%. Срок депозита 5 месяцев. Определить наращенную сумму в рублях к концу операции. Оценить доходность операции. 3. Оцените валютные риски компании ПАО «Компас» осуществляющую экспорт драг. металла за рубеж. Условие кейса представлено ниже. Компания ПАО «Компас» закупила товар на сумму в 100 млн. руб., который реализовала в виде экспортной поставки за 3,8 млн. долларов США. Какова эффективность этой операции, если операция заняла две недели, таможенная пошлина составила 10% от валютной выручки, курс покупки долларов банком в конце операции равнялся 66,89 руб. за доллар США. Временная база 365.
ПКП-3	1.Обладает	Знать: способы	1. С каким риском

Способность разрабатывать финансовую стратегию организации, долгосрочную и краткосрочную финансовую политику, а также принимать эффективные управленческие решения, обеспечивающие достижение стоящих перед организацией целей	навыками разработки финансовой стратегии и политики. 2.Использует современные методы и средства для принятия эффективных финансовых решений.	анализа задач и методов теории принятия решений и особенности принятия решений в управлении рисками; Уметь: принимать решения в области менеджмента рисков без использования численных значений вероятностей исходов, т.е. в условиях определенности; Знать: понятие управленческого решения, количественные и качественные методы принятия управленческих решений, методы принятия решений в условиях риска и неопределённости. Уметь: принимать управленческие решения с использованием численных значений вероятностей исходов (т. е. в условиях неопределенности) и построения дерева управленческих решений	сталкивается автолюбитель, приобретающий автомобиль стоимостью 20 000 евро и имеющий привычку менять автомобиль каждые три года, если стоимость аренды автомобиля составляет 4000 евро в год, а банковская процентная ставка равна 10%. Как можно этим риском управлять? 2. Постройте экономико-математическую модель следующей задачи. Имеются три поставщика и четыре потребителя. Мощность поставщиков и спросы потребителей, а также затраты на перевозку единицы груза для каждой пары "поставщик — потребитель" сведены в таблицу поставок. Учтите риск того, что возможны дорожные работы на пути от 2-го поставщика к 4-му потребителю. 3. Инвестор планирует вложить средства в мясоперерабатывающие предприятия А и Б. Надежность первого оценивается экспертами на уровне 70 %, а второго – 85 %. Чему равна вероятность того, что: а) оба предприятия в течение года не станут банкротами? б) наступит хотя бы одно банкротство?
ПКП-5 Способность реализовывать инвестиционные решения, осуществлять формирование и управление портфелем финансовых и реальных активов организации в целях	1.Владеет методами оценки инвестиций и активов организации	Знать: методы сбора информации: наблюдений, обследований, опросов, опросов фокусных групп, сбора статистических данных и экспериментов. Уметь: определить тип необходимой информации; получить первичные данные; получить вторичные данные путем анализа	1. Соберите всю необходимую информацию и проведите PEST-анализ экономического положения компании ПАО «Газпром» 2. На основе данных PEST-анализа проведите SWOT-анализ для компании ПАО «Газпром» 3. На основе полученных результатов PEST- и SWOT-анализа составьте реестр

максимизации ее стоимости	2. Применяет современные методы и модели управления инвестициями в целях максимизации стоимости бизнеса	отчетов компании, интервьюирования и анкетирования сотрудников и руководства компании. Знать: методы анализа и синтеза необходимой информации; методы контроля, мониторинга и прогнозирования рисков. Уметь: использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; организовывать работу исполнителей для выполнения работ, в области менеджмента рисков.	рисков компании ПАО «Газпром» 4. Торговый агент предлагает предприятиям новый продукт. Из предыдущего опыта ему известно, что в среднем 1 из 65 клиентов, которым он предлагает товар, покупает его. В течение некоторого промежутка времени он предложил продукт 20 предприятиям. Чему равна вероятность того, что он продаст им хотя бы единицу товара?
---------------------------	---	---	--

Таблица 7.3

Профиль «Менеджмент и управление бизнесом»

Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (умения и знания), соотнесенные с индикаторами достижения компетенции	Типовые контрольные задания
ПКП-1 Способность планировать, организовывать и контролировать командную работу, вести деловые переговоры и реагировать на изменения	1. Демонстрирует владение методами планирования, организации и контроля командной работы. 2. Применяет современные отечественные и	Знать: способы анализа задач и методов теории принятия решений и особенности принятия решений в управлении рисками; Уметь: принимать решения в области менеджмента рисков без использования численных значений вероятностей исходов, т. е. в условиях определенности. Знать: понятие управленческого решения, количественные и качественные методы	1. Постройте экономико-математическую модель следующей задачи. Имеются три поставщика и четыре потребителя. Мощность поставщиков и спросы потребителей, а также затраты на перевозку единицы груза для каждой пары "поставщик — потребитель" сведены в таблицу поставок. Учтите риск того, что возможны дорожные работы на пути от 2-го поставщика к 4-му потребителю. 2. Инвестор планирует вложить средства в

	зарубежные переговорные технологии в ходе деловых коммуникаций.	принятия управленческих решений, методы принятия решений в условиях риска и неопределённости; Уметь: принимать управленческие решения с использованием численных значений вероятностей исходов (т. е. в условиях неопределенности) и построения дерева управленческих решений.	мясоперерабатывающие предприятия А и Б. Надежность первого оценивается экспертами на уровне 70 %, а второго – 85 %. Чему равна вероятность того, что: а) оба предприятия в течение года не станут банкротами? б) наступит хотя бы одно банкротство?
ПКП-5 Способность оценивать риски и разрабатывать программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций	1. Демонстрирует навыки по оценке рисков и мониторинга деятельности компании. 2. Разрабатывает программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций.	Знать: методы сбора информации: наблюдений, обследований, опросов, опросов фокусных групп, сбора статистических данных и экспериментов. Уметь: определить тип необходимой информации; получить первичные данные; получить вторичные данные путем анализа отчетов компании, интервьюирования и анкетирования сотрудников и руководства компании. Знать: методы анализа и синтеза необходимой информации; методы контроля, мониторинга и прогнозирования рисков. Уметь: использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; организовывать работу исполнителей для выполнения работ, в области менеджмента рисков.	1. Соберите всю необходимую информацию и проведите PEST-анализ экономического положения компании ПАО «Газпром» 2. На основе данных PEST-анализа проведите SWOT-анализ для компании ПАО «Газпром» 3. На основе полученных результатов PEST- и SWOT-анализа составьте реестр рисков компании ПАО «Газпром» 4. Торговый агент предлагает предприятиям новый продукт. Из предыдущего опыта ему известно, что в среднем 1 из 65 клиентов, которым он предлагает товар, покупает его. В течение некоторого промежутка времени он предложил продукт 20 предприятиям. Чему равна вероятность того, что он продаст им хотя бы единицу товара?

Примерный перечень вопросов к экзамену

1. Риск-менеджмент как отрасль научного управления.
2. Основные направления риск-менеджмента.

3. Цель и задачи дисциплины риск-менеджмента.
4. История возникновения дисциплины риск-менеджмента.
5. Законы и принципы дисциплины риск-менеджмента.
6. Механизм формирования принципов управления.
7. Функции риск-менеджмента.
8. Измерение риска. Шкалы измерений параметров.
9. Сущность управленческих решений.
10. Риск и неопределенность.
11. Неопределенность информации и понятие энтропии.
12. Риски и их классификация.
13. Логистические риски. Классификация логистических рисков.
14. Риски маркетинговой деятельности.
15. Финансовые риски.
16. Инфляционные и дефляционные риски.
17. Подготовка, принятие и реализация управленческих решений.
18. Зоны риска и принятие управленческих решений.
19. Методы разработки и принятия управленческих решений в системе риск-менеджмента.
20. Международные стандарты менеджмента рисков.
21. Стратегия управления рисками.
22. Политика риск-менеджмента хозяйствующего субъекта.
23. Основные формы политики риск-менеджмента.
24. Сущность тактического управления рисками.
25. Внутренние риски хозяйствующего субъекта.
26. Мониторинг рисков и его сущность.
27. Основные виды административных рисков.
28. Управление риском и его сущность.
29. Управление техническими и производственными рисками.
30. Особенности управления социальными рисками.
31. Характеристика и структура внешней среды хозяйствующего субъекта.
32. Политические риски и их классификация.
33. Сущность финансовых рисков и риск-менеджмент.
34. Природные риски и их влияние на экономику.
35. Национальные риски в современном менеджменте.
36. Экологические риски. Управление экологическими рисками.
37. Специфика демографических рисков.
38. Влияние криминогенных рисков на развитие бизнеса.
39. Отраслевые и структурные риски.
40. Оценка риска на основе расчета порога рентабельности и запаса финансовой прочности.
41. Оценка риска на основе эффекта операционного рычага.

42. Оценка риска на основе кривой спроса и линии безубыточного прироста продаж.
43. Оценка риска на основе эффекта финансового рычага.
44. Метод составления матрицы последствий и матрицы рисков.
45. Риск и критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: критерий минимакса.
46. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: критерий Сэвиджа.
47. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: правило Гурвица (α -критерий)
48. Риск и критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: критерий Байеса-Лапласа
49. Диверсификации портфеля ценных в условиях неопределенности валютного рынка.
50. Количественная оценка рисков альтернативных вариантов инвестирования.

Пример экзаменационного билета

**Федеральное государственное образовательное бюджетное учреждение
высшего образования
«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»
(Финансовый университет)**

Департамент менеджмента и инноваций
Дисциплина «Риск-менеджмент»
Факультет «Высшая школа управления»
Форма обучения: очная
Семестр 7
Направление 38.03.02 «Менеджмент»
Профиль «Финансовый менеджмент»

Экзаменационный билет №__

Задание 1. (15 баллов). Теоретический вопрос.

Понятие и сущность отраслевых и структурных рисков.

Задание 2. (15 баллов). Тестовое задание.

Тест 1. Величина, характеризующая свойство объекта, значения которой определяются по количественной шкале – это ...

- а) свойство объекта
- б) состояние элемента системы
- в) параметр объекта
- г) системное свойство
- д) интервал
- е) значение

Тест 2. Вероятность совершения детерминированного события в момент времени t_i стремится к ...

Тест 3. Риски в зависимости от результата возможного рискового события подразделяют на ...

- а) инфляционные и спекулятивные
- б) инфляционные и дефляционные
- в) естественные и искусственные
- г) постоянные и временные
- д) статические и динамические
- е) чистые и спекулятивные

Тест 4. Риски, возникающие в процессе реализации товаров и услуг, транспортировки и приемки их покупателем – это ... риски

Тест 5. Одно из основных направлений современного менеджмента, изучающее проблемы управления рисками, возникающими в деятельности организации – это ...

Задание 3. (30 баллов). Практико-ориентированное задание.

С каким риском сталкивается автолюбитель, приобретающий автомобиль стоимостью 32 000 евро и имеющий привычку менять автомобиль каждые три года, если стоимость аренды автомобиля составляет 5500 евро в год, а банковская процентная ставка равна 10%. Как можно этим риском управлять?

Подготовил:

Утверждаю:

Дата:

Примерный перечень вопросов к зачету

1. Риск-менеджмент как отрасль научного управления.
2. Основные направления риск-менеджмента.
3. Измерение риска. Шкалы измерений параметров.
4. Сущность управленческих решений.
5. Риск и неопределенность.
6. Неопределенность информации и понятие энтропии.
7. Риски и их классификация.
8. Логистические риски. Классификация логистических рисков.
9. Риски маркетинговой деятельности.
10. Финансовые риски.
11. Инфляционные и дефляционные риски.
12. Подготовка, принятие и реализация управленческих решений.
13. Методы разработки и принятия управленческих решений в системе риск-менеджмента.

14. Международные стандарты менеджмента рисков.
15. Стратегия управления рисками.
16. Политика риск-менеджмента хозяйствующего субъекта.
17. Внутренние риски хозяйствующего субъекта.
18. Мониторинг рисков и его сущность.
19. Основные виды административных рисков.
20. Управление риском и его сущность.
21. Управление техническими и производственными рисками.
22. Особенности управления социальными рисками.
23. Характеристика и структура внешней среды хозяйствующего субъекта.
24. Сущность финансовых рисков и риск-менеджмент.
25. Экологические риски. Управление экологическими рисками.
26. Отраслевые и структурные риски.
27. Метод составления матрицы последствий и матрицы рисков.
28. Риск и критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: критерий минимакса.
29. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: критерий Сэвиджа.
30. Диверсификации портфеля ценных в условиях неопределенности валютного рынка.

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

8.1. Основная литература:

1. Риск-менеджмент : учебное пособие / под ред. Л. П. Дашкова. - 2-е изд. - Москва : Дашков и К, 2022. - 322 с. - ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1927299> (дата обращения: 15.04.2023). – Текст : электронный.
2. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. - 7-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020.

- 372 с. - ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1091116> (дата обращения: 15.04.2023). – Текст : электронный.
3. Вяткин, В.Н. Риск-менеджмент: учебник / В.Н. Вяткин, В.А. Гамза, Ф.В. Маевский. - Москва: Юрайт, 2015, 2016. - 353 с. - (Авторский учебник). – Текст : непосредственный.
- Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 365 с. — (Высшее образование). — Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/511018> (дата обращения: 15.04.2023). — Текст : электронный.

8.2. Дополнительная литература:

4. Окулов, В. Л. Риск-менеджмент : основы теории и практика применения : учебное пособие / В. Л. Окулов. – Санкт-Петербург : Изд-во С.-Петерб. ун-та, 2019. - 280 с. - ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1080924> (дата обращения: 15.04.2023). - Текст : электронный.
5. Ряховская, А.Н. Риск-менеджмент - основа устойчивости бизнеса: учебное пособие / А.Н. Ряховская, О.Г. Крюкова, М.О. Кузнецова; Финуниверситет; под ред. О.Г. Крюковой. - Москва: Магистр, 2018. - 256 с. - Текст : непосредственный. - То же. - 2022. - ЭБС ZNANIUM.com. - URL : <https://znanium.com/catalog/product/1891646> (дата обращения: 15.04.2023). - Текст : электронный.
6. Тихомиров, Н. П. Теория риска : учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / Н. П. Тихомиров, Т. М. Тихомирова. - Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2020. - 308 с. - ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1376400> (дата обращения: 15.04.2023). – Текст : электронный.
7. Соколов, Д.В. Базисная система риск-менеджмента организаций реального сектора экономики: Монография / Д.В. Соколов, А.В. Барчуков. — Москва:

Инфра-М, 2013 — 126 с. — (Научная мысль). - Текст: непосредственный. - То же. - ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1938001> (дата обращения: 15.04.2023). – Текст : электронный.

8. Домашенко, Д. В. Современные подходы к корпоративному риск-менеджменту: методы и инструменты / Д. В. Домашенко, Ю. Ю. Финогенова. - Москва : Магистр : ИНФРА-М, 2019. - 304 с. - ЭБС ZNANIUM.com. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1006768> (дата обращения: 15.04.2023). – Текст : электронный.

9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети

«Интернет», необходимых для освоения дисциплины

1. Электронная библиотека Финансового университета (ЭБ) <http://elib.fa.ru/>
2. Электронно-библиотечная система BOOK.RU <http://www.book.ru>
3. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека ОНЛАЙН» <http://biblioclub.ru/>
4. Электронно-библиотечная система Znanium <http://www.znanium.com>
5. Образовательная платформа Юрайт <https://urait.ru/>
6. Деловая онлайн-библиотека Alpina Digital <http://lib.alpinadigital.ru/>
7. Научная электронная библиотека eLibrary.ru <http://elibrary.ru>
8. Электронная библиотека <http://grebennikon.ru>
9. Национальная электронная библиотека <http://нэб.рф/>
10. Диссертации и авторефераты на сайте Высшей аттестационной комиссии (ВАК) <https://vak.minobrnauki.gov.ru/>

Интернет-ресурсы

Адрес	Название ресурса
https://portal.fa.ru	Информационно-образовательный портал Финансового университета при Правительстве РФ
http://www.gks.ru	Портал Федеральной службы государственной статистики

https://www.minfin.ru/ru/	Официальный сайт Министерства финансов РФ
http://www.roskazna.ru/	Официальный сайт Федерального казначейства
https://www.nalog.ru	Официальный сайт Федеральной налоговой службы РФ
https://www.rbc.ru/	Официальный сайт агентства РБК
https://investfunds.ru/	Investfunds PRO – профессиональная база данных российских институциональных инвесторов
http://www.garant.ru	Информационно-правовая система «Гарант»
http://www.consultant.ru	Информационно-правовая система «Консультант Плюс»
http://www.1fd.ru/	Финансовая справочная система «Финансовый директор»

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Для успешного усвоения дисциплины необходимо материалы, изложенные преподавателем на лекциях, закреплять в процессе выполнения практических занятий и в процессе самостоятельной работы, которой уделяется большое внимание. В процессе изучения данной дисциплины комплексно используются традиционные и инновационные технологии, активные и интерактивные формы занятий: лекции-беседы, лекции с элементами проблемного изложения, лекции-дискуссии, семинары, решение практических ситуаций и расчетно-аналитических задач, самостоятельная работа с элементами научно-исследовательской и творческой деятельности и др.

Задачами интерактивных форм обучения являются:

- эффективное усвоение учебного материала;
- самостоятельный поиск студентами путей и вариантов решения поставленной учебной задачи;
- установление воздействия между студентами, обучение работать в команде;

- формирование у студентов объективного мнения по изучаемой тематике;
- формирование жизненных и профессиональных навыков.

Студентам предоставляются лекционные материалы преподавателя с вопросами для закрепления материала по каждой изучаемой теме. Для выполнения практических заданий студенты получают условия практико-ориентированных, расчетно-аналитических и кейсовых заданий, решение которых будет способствовать получению практических навыков в области инструментария и методологии решения проблем и поиска новых идей решения задач.

Цель организации самостоятельной работы по дисциплине – это углубление и расширение знаний в области решения нестандартных задач и поиска идей. Самостоятельная работа студентов (СРС) является важнейшим видом освоения содержания дисциплины, подготовки к практическим занятиям и к экзамену. Сюда же относятся и самостоятельное углубленное изучение тем дисциплины. Самостоятельная работа студентов предполагает работу студентов, выполняемую по заданию и при методическом руководстве преподавателя, но без его непосредственного участия. Выделяется два вида самостоятельных работ:

- контролируемая самостоятельная работа (КСР), направленная на углубление и закрепление знаний студентов по проблематике учебной дисциплины;

- обязательная самостоятельная работа (СРС), обеспечивающая подготовку студентов к текущим аудиторным занятиям.

Самостоятельная работа реализуется:

- непосредственно в процессе аудиторных занятий – на лекциях, практических и семинарских занятиях;

- в контакте с преподавателем вне рамок расписания - на консультациях по учебным вопросам, в ходе творческих контактов, при ликвидации задолженностей, при выполнении индивидуальных заданий и т.д.;

- в электронной образовательной среде – библиотеке, дома, в Департаменте при выполнении студентом учебных задач. Выделенные часы для СРС используются для знакомства с дополнительной научной литературой по

проблематике дисциплины, анализа научных концепций и современных подходов к решению рассматриваемых проблем. Задание к каждому занятию в рамках обязательной самостоятельной работы предполагает более углубленное изучение отдельных вопросов темы, подготовку к решению практических ситуаций на аудиторных занятиях. К самостоятельной работе студентов относится также работа в библиотеке, электронных поисковых системах и т.п. по сбору материалов, необходимых для выполнения конкретных заданий преподавателя по изучаемым темам.

Подготовка к занятиям и работа с материалом

Продуктивность усвоения учебного материала во многом определяется интенсивностью и качеством работы студента. Практические занятия и самостоятельная работа предполагают формирование культуры умственного труда, самостоятельности и инициативы в поиске и приобретении знаний; закрепление знаний и навыков, полученных на всех видах учебных занятий; подготовку к предстоящим занятиям, экзаменам.

Основу работы студента составляет работа с учебной и научной литературой. Из опыта работы с научными источниками следует определенная последовательность действий, которой целесообразно придерживаться. Сначала прочитать весь текст в быстром темпе. Цель такого чтения в том, чтобы создать общее представление об изучаемом (не запоминать, а понять общий смысл прочитанного). Затем прочитать вторично, более медленно, чтобы в ходе чтения понять и запомнить смысл каждой фразы, каждого положения и вопроса в целом.

Чтение приносит пользу и становится продуктивным, когда сопровождается записями. Это может быть составление плана прочитанного текста, тезисы или выписки, конспектирование и др.

Выбор вида записи зависит от характера изучаемого материала и целей работы с ним.

Если содержание материала несложное, легко усваиваемое, можно ограничиться составлением плана.

Если материал содержит новую и трудно усваиваемую информацию, целесообразно его законспектировать. Результаты конспектирования могут быть представлены в различных формах.

План – это схема прочитанного материала, краткий (или подробный) перечень вопросов, отражающих структуру и последовательность материала. Подробно составленный план вполне заменяет конспект.

Конспект – это систематизированное, логичное изложение материала источника. Различаются четыре типа конспектов.

План-конспект – это развернутый детализированный план, в котором достаточно подробные записи приводятся по тем пунктам плана, которые нуждаются в пояснении.

Текстуальный конспект – это воспроизведение наиболее важных положений и фактов источника.

Свободный конспект – это четко и кратко сформулированные (изложенные) основные положения в результате глубокого осмысливания материала. В нем могут присутствовать выписки, цитаты, тезисы; часть материала может быть представлена планом.

Тематический конспект – составляется на основе изучения ряда источников и дает более или менее исчерпывающий ответ по какой-то схеме (вопросу).

В процессе изучения материала источника, составления конспекта нужно обязательно применять различные выделения, подзаголовки, создавая блочную структуру конспекта. Это делает конспект легко воспринимаемым, удобным для работы.

Подготовка информационного сообщения – вид внеаудиторной самостоятельной работы по подготовке небольшого по объёму устного сообщения для озвучивания на семинаре, практическом занятии. Сообщаемая информация носит характер уточнения или обобщения, несёт новизну, отражает современный взгляд по определённым проблемам.

Сообщение отличается от докладов и рефератов не только объёмом информации, но и её характером – сообщения дополняют изучаемый вопрос фактическими или статистическими материалами. Оформляется задание

письменно, оно может включать элементы наглядности (иллюстрации, демонстрацию).

Составление обобщающей таблицы по теме – это вид самостоятельной работы студента по систематизации объёмной информации, которая сводится (обобщается) в рамки таблицы. Формирование структуры таблицы отражает склонность студента к систематизации материала и развивает его умения по структурированию информации.

Составление графологической структуры – это продуктивный вид самостоятельной работы студента по систематизации информации в рамках логической схемы с наглядным графическим её изображением. Графологическая структура как способ систематизации информации ярко и наглядно представляет её содержание. Работа по созданию даже самых простых логических структур способствует развитию у студентов приёмов системного анализа, выделения общих элементов и фиксирования дополнительных, умения абстрагироваться от них в нужной ситуации. В отличие от других способов графического отображения информации (таблиц, рисунков, схем) графологическая структура делает упор на логическую связь элементов между собой, графика выступает в роли средства выражения (наглядности).

Подготовка к семинарским и практическим занятиям

При подготовке к семинарам и практическим занятиям следует изучить основную литературу, ознакомиться с дополнительной литературой, а также новыми публикациями в периодических изданиях: журналах, газетах и т.д. Это позволит:

- обобщить и систематизировать ранее изученный материал, внося в него соответствующие записи из литературы, рекомендованной преподавателем и предусмотренной учебной программой;
- подготовить тезисы выступлений по вопросам, выносимым на семинар.

Начиная подготовку к семинару, следует:

- четко определить смысл заданий, которые предстоит выполнить;

- составить план, позволяющий установить ключевые моменты подготовки и их последовательность. Данное действие позволит студенту повысить свою дисциплинированность и организованность.

Начинать подготовку следует с изучения рекомендованной литературы. Необходимо помнить, что лекционный материал носит обзорный характер и содержит наиболее значимые вопросы по рассматриваемой теме. Остальные, более детальные, но не менее значимые вопросы должны быть разобраны студентом самостоятельно. В этой связи работа с рекомендованной литературой обязательна. В ходе работы следует обратить особое внимание на объяснение явлений и фактов практической действительности с точки зрения анализируемых теоретических положений, а также соотнести их с содержанием основных выводов. В ходе данной работы студент должен стремиться понять и запомнить основные положения рассматриваемого материала, поясняющие его примеры, а также разобраться в иллюстративном материале.

Заканчивать подготовку к семинару следует составлением конспекта, позволяющим составить концентрированное (сжатое) представление об изученном вопросе. Конспект можно представить, как в текстовом формате, так и в виде схемы или алгоритма.

Подготовка к групповой дискуссии

Подготовка к групповой дискуссии строиться по тому же принципу, что и подготовка к семинару. Вначале студенту рекомендуется изучить соответствующую литературу, и далее, составить план-конспект своего выступления.

При работе с литературой рекомендуется делать выписки наиболее интересных и показательных положений с точным указанием выходных данных: авторов книг и статей, года и места издания, страниц, названий сайтов и др. Данная информация будет необходима для оформления ссылок и библиографического списка.

Студент может дополнить список использованной литературы современными источниками, не представленными в списке рекомендованной

литературы, и в дальнейшем использовать собственные подготовленные учебные материалы при написании курсовых и дипломных работ.

Также необходимо продумать примеры с целью аргументации тесной связи излагаемого в дискуссии теоретического материала с реальной жизнью и обеспечения заинтересованности аудитории студентов, для которых готовится сообщение.

Следует учитывать, что ориентировочная продолжительность выступления в дискуссии должна составлять 3-5 минут, поэтому из найденного по теме материала следует сделать «жесткую выжимку», проиллюстрировав ее примерами.

Следует помнить, что задача докладчика – построить свое выступление так, чтобы оно стало фундаментом для последующей дискуссии.

Подготовка к решению кейсов

Одной из особенностей обучения бакалавров является активное использование метода выполнения кейсовых заданий. Подготовка к кейсу осуществляется в процессе изучения учебного пособия и лекционного материала по дисциплине и ответов на тестовые задания, предлагаемые студентам после каждой темы. При этом переход к изучению следующей темы возможен только после правильного выполнения кейсовых заданий по предыдущей теме.

Методические рекомендации по выполнению контрольной работы.

Выполнение контрольной работы направлено на оценку качества усвоения студентами дисциплины, владения навыками решения практических заданий. При подготовке к выполнению работы студент должен изучить рекомендуемые нормативные правовые акты и учебную литературу, а также повторить ключевые положения и определения по изученным вопросам учебной дисциплины. В ходе выполнения работы студент должен проявить знания основных вопросов по темам учебной дисциплины, а также умения решать типовые задачи, формулировать четкие и содержательные ответы на вопросы, проводить сравнительную оценку. Контрольная работа предполагает письменный ответ на вопрос, который должен отразить знание студентом понятийного аппарата. При

работе учитывается правильность ответов на задания, отсутствие содержательных и терминологических ошибок, соответствие нормативным правовым актам.

10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем

11. 1. Комплект лицензионного программного обеспечения:

1. Windows, Microsoft Office.
2. Антивирус Kaspersky

11.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Информационно-правовая система «Гарант»
2. Информационно-правовая система «Консультант Плюс»
3. Электронная энциклопедия: <http://ru.wikipedia.org/wiki/Wiki>
4. Система комплексного раскрытия информации «СКРИН» - <http://www.skrin.ru/>

11.3. Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации - не используются

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

Для осуществления образовательного процесса в рамках дисциплины необходимо наличие специальных помещений.

Специальные помещения представляют собой учебные аудитории для проведения лекций, семинарских и практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы и помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования.

Специальные помещения должны быть укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Проведение лекций и семинаров в рамках дисциплины осуществляется в помещениях:

- оснащенных демонстрационным оборудованием;
- оснащенных компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет»;
- обеспечивающих доступ в электронную информационно-образовательную среду университета.