

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования "Пермский
государственный национальный исследовательский
университет"

Кафедра менеджмента

Авторы-составители: **Носкова Оксана Евгеньевна**

Рабочая программа дисциплины
УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ
Код УМК 62891

Утверждено
Протокол №6
от «11» марта 2020 г.

Пермь, 2020

1. Наименование дисциплины

Управление рисками

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина входит в вариативную часть Блока « Б.1 » образовательной программы по направлениям подготовки (специальностям):

Направление: **38.03.02** Менеджмент
направленность Менеджмент организации

3. Планируемые результаты обучения по дисциплине

В результате освоения дисциплины **Управление рисками** у обучающегося должны быть сформированы следующие компетенции:

38.03.02 Менеджмент (направленность : Менеджмент организации)

ПК.11 уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании

4. Объем и содержание дисциплины

Направления подготовки	38.03.02 Менеджмент (направленность: Менеджмент организации)
форма обучения	очная
№№ триместров, выделенных для изучения дисциплины	11
Объем дисциплины (з.е.)	4
Объем дисциплины (ак.час.)	144
Контактная работа с преподавателем (ак.час.), в том числе:	56
Проведение лекционных занятий	28
Проведение практических занятий, семинаров	28
Проведение лабораторных работ, занятий по иностранному языку	0
Самостоятельная работа (ак.час.)	88
Формы текущего контроля	Входное тестирование (1) Итоговое контрольное мероприятие (1) Письменное контрольное мероприятие (3)
Формы промежуточной аттестации	Экзамен (11 триместр)

5. Аннотированное описание содержания разделов и тем дисциплины

Введение в дисциплину "Управление рисками"

Вводное занятие, первое знакомство с курсом: его предмет, цели и задачи. Рассмотрение взаимосвязи анализа и управления рисками с другими дисциплинами.

Тема 1. Природа риска и классификация рисков.

Понятие риска. Формы проявления риска. Природа риска: риски, обусловленные вероятностью, и риски, обусловленные неопределенностью. Предпринимательские и непредпринимательские риски. Многообразие финансовых рисков. Особенности классификации финансовых рисков. Основные элементы классификации рисков.

Тема 2. Методы определения вероятности и последствий рисков

Сущность статистических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия. Статистические методы, определяющие степень риска предприятия с помощью вероятности наступления событий. Риск как мера неопределенности ожидаемого дохода. Риск как мера колеблемости дохода. Математико-статистические показатели риска в терминах распределения вероятностей ожидаемого дохода и среднеквадратического отклонения от среднеожидаемого дохода. Вариация, ковариация, корреляция. Среднеквадратическое отклонение от среднего наблюдавшегося дохода. Уменьшение этих показателей как цель и содержание управления рисками. Положительные и отрицательные стороны статистических методов.

Тема 3. Стратегии решений в условиях риска

Сущность аналитических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия. Игровые модели. Метод анализа целесообразности затрат. Методы расчета и анализа основных показателей финансово-хозяйственной деятельности предприятия. Модели по определению и оценке риска банкротства предприятия. Положительные и отрицательные стороны аналитических методов. Дерево решений. Планирование управления рисками.

Тема 4. Планирование реагирования на риски, мониторинг и контроль рисков

Избежание и лимитирование рисков. Особенности применения данной методики. Внутренние меры и разработка системы нормативов. Диверсификация. Понятие и типы. Основные направления диверсификации.

Передача и хеджирование рисков. Общая характеристика и способы осуществления. Страхование и самострахование. Понятие страхования и самострахования. Применение самострахования. Сравнительная оценка экономической эффективности страхования и самострахования, метод Хаустона.

Тема 5. Оценка экономического эффекта от управления рисками

Избежание и лимитирование рисков. Особенности применения данной методики. Внутренние меры и разработка системы нормативов. Диверсификация. Понятие и типы. Основные направления диверсификации.

Передача и хеджирование рисков. Общая характеристика и способы осуществления. Страхование и самострахование. Понятие страхования и самострахования. Применение самострахования. Сравнительная оценка экономической эффективности страхования и самострахования, метод Хаустона. Этапы планирования реагирования на риски. Разработка плана противодействия появлению рисков и снижения их величины. Методы управления рисками и выбор процедур контроля. Мониторинг и контроль рисков.

Тема 6. Риск-менеджмент. Анализ и управление кредитными рисками.

Управление рыночными рисками. Понятие и определение рыночного риска. Казначейский и

процентный риск. Общая доходность и риск-кованность рыночного портфеля финансового института. Метод CAPM. Методология VAR. Описание, преимущества, определение базовых элементов. Основные методы вычисления VAR: аналитический, историческое моделирование, статистическое моделирование. Границы применения метода. Метод Shortfall. Сценарии What-If и использование многофакторных моделей.

Управление кредитными рисками. Понятие и определение кредитного риска. Методы управления кредитными рисками. Анализ предоставляемой информации. Анализ технико-экономического обоснования кредита. Анализ кредитоспособности заемщика. Оценка персональных качества заемщика. Правило «пяти си». Структурный анализ кредита: цель кредита, сумма кредита, порядок погашения, срок, обеспечение кредита, процентная ставка, прочие условия. Оформление и контроль за исполнением кредитной сделки. Личностные качества персонала финансового института и человеческий фактор. Управление операционными рисками. Понятие и определение операционного риска. Классификации операционных рисков. Методы анализа операционных рисков. Статистический анализ распределения фактических убытков. Балльно-весовой метод (метод оценочных карт). Сценарный анализ. Методы управления операционными рисками. Аутсорсинг и страхование. Разработка комплексных планов по обеспечению непрерывности и восстановления финансово-хозяйственной деятельности.

Тема 7. Анализ и управление валютным риском и риском процентной ставки

Виды рыночных рисков. Волатильность и способы ее моделирования. Структура валютного риска.

Колебания курсов валют как основа существования валютного риска. Своп-риск.

Риск фиксированной процентной ставки (риск ФПС), риск плавающей процентной ставки (риск ППС).

Основные подходы к анализу и количественной оценке риска процентной ставки: баланс связанности, анализ дюрации, баланс эластичности. Инструменты управления риском процентной ставки: futures, options, forward rate agreement.

Тема 8. Анализ и управление риском ликвидности и риском инвестиционных проектов. Анализ чувствительности проекта

Понятие риска ликвидности. Источники возникновения риска ликвидности. Структура риска ликвидности. Основные направления минимизации риска ликвидности.

Профиль риска инвестиционных проектов. Источники возникновения рисков инвестиционных проектов. Анализ и оценка рисков инвестиционных проектов. Управление рисками инвестиционных проектов. Страхование рисков инвестиционных проектов.

6. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Освоение дисциплины требует систематического изучения всех тем в той последовательности, в какой они указаны в рабочей программе.

Основными видами учебной работы являются аудиторские занятия. Их цель - расширить базовые знания обучающихся по осваиваемой дисциплине и систему теоретических ориентиров для последующего более глубокого освоения программного материала в ходе самостоятельной работы. Обучающемуся важно помнить, что контактная работа с преподавателем эффективно помогает ему овладеть программным материалом благодаря расстановке необходимых акцентов и удержанию внимания интонационными модуляциями голоса, а также подключением аудио-визуального механизма восприятия информации.

Самостоятельная работа преследует следующие цели:

- закрепление и совершенствование теоретических знаний, полученных на лекционных занятиях;
- формирование навыков подготовки текстовой составляющей информации учебного и научного назначения для размещения в различных информационных системах;
- совершенствование навыков поиска научных публикаций и образовательных ресурсов, размещенных в сети Интернет;
- самоконтроль освоения программного материала.

Обучающемуся необходимо помнить, что результаты самостоятельной работы контролируются преподавателем во время проведения мероприятий текущего контроля и учитываются при промежуточной аттестации.

Обучающимся с ОВЗ и инвалидов предоставляется возможность выбора форм проведения мероприятий текущего контроля, альтернативных формам, предусмотренным рабочей программой дисциплины. Предусматривается возможность увеличения в пределах 1 академического часа времени, отводимого на выполнение контрольных мероприятий.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации.

При проведении текущего контроля применяются оценочные средства, обеспечивающие передачу информации, от обучающегося к преподавателю, с учетом психофизиологических особенностей здоровья обучающихся.

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

При самостоятельной работе обучающимся следует использовать:

- конспекты лекций;
- литературу из перечня основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля);
- текст лекций на электронных носителях;
- ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимые для освоения дисциплины;
- лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение из перечня информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине;
- методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.

8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы

Основная:

1. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. <https://www.urait.ru/bcode/447050>
2. Разработка системы управления рисками и капиталом (ВПОДК) : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. Д. Дугин [и др.] ; под научной редакцией А. Д. Дугина, Г. И. Пенникаса. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 367 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-4949-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. <https://www.urait.ru/bcode/437045>
3. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1 : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 211 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02606-1. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. <https://www.urait.ru/bcode/434330>
4. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3 : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 272 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02609-2. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. <https://www.urait.ru/bcode/434332>
5. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 2 : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 250 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02608-5. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. <https://www.urait.ru/bcode/434331>
6. Гибсон, Роджер Формирование инвестиционного портфеля: Управление финансовыми рисками / Роджер Гибсон. — 2-е изд. — Москва : Альпина Бизнес Букс, 2019. — 280 с. — ISBN 978-5-9614-0775-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. <http://www.iprbookshop.ru/82378.html>
7. Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов / В. Е. Шкурко ; под научной редакцией А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2019 ; Екатеринбург : Изд-во Урал. ун-та. — 182 с. — (Университеты России). — ISBN 978-5-534-05843-7 (Издательство Юрайт). — ISBN 978-5-7996-1266-5 (Изд-во Урал. ун-та). — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. <https://www.urait.ru/bcode/441677>
8. Балдин, К. В. Управление рисками : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления (060000) / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 511 с. — ISBN 5-238-00861-9. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. <http://www.iprbookshop.ru/71229>
9. Основы риск-менеджмента / Д. Гэлаи, М. Кроуи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 390 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02578-1. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. <https://www.urait.ru/bcode/431722>

Дополнительная:

1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 365 с. — (Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. <https://www.ura.it.ru/bcode/432176>
2. Рахимова, Н. Н. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебное пособие / Н. Н. Рахимова. — Оренбург : Оренбургский государственный университет, ЭБС АСВ, 2016. — 191 с. — ISBN 978-5-7410-1538-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. <http://www.iprbookshop.ru/69961.html>
3. Дубина И. Н. Основы управления рисками: Учебное пособие/Дубина И. Н..-Саратов:Вузовское образование,2018, ISBN 978-5-4487-0271-6.-266. <http://www.iprbookshop.ru/76240.html>

9. Перечень ресурсов сети Интернет, необходимых для освоения дисциплины

<http://rrms.ru/> Портал Русского общества управления рисками

<http://www.riskovik.com/articles/> Профессиональный портал для риск-менеджеров

<https://upravlenie-riskami.ru/> Управление рисками

10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

Образовательный процесс по дисциплине **Управление рисками** предполагает использование следующего программного обеспечения и информационных справочных систем:

- 1) презентационные материалы (слайды по темам лекционных занятий);
- 2) доступ в режиме on-line в Электронную библиотечную систему (ЭБС);
- 3) доступ в электронную информационно-образовательную среду университета;
- 4) интернет-сервисы и электронные ресурсы
- 5) Тестирование

Перечень необходимого лицензионного и (или) свободно распространяемого программного обеспечения:

1. Приложения, позволяющее просматривать и воспроизводить медиаконтент PDF-файлов;
2. Офисные пакеты приложений;
3. Программы, демонстрации видео материалов (проигрыватель).

Изучение дисциплины не требует специального программного обеспечения

При освоении материала и выполнения заданий по дисциплине рекомендуется использование материалов, размещенных в Личных кабинетах обучающихся ЕТИС ПГНИУ (**student.psu.ru**).

При организации дистанционной работы и проведении занятий в режиме онлайн могут использоваться:

система видеоконференцсвязи на основе платформы BigBlueButton (<https://bigbluebutton.org/>).

система LMS Moodle (<http://e-learn.psu.ru/>), которая поддерживает возможность использования текстовых материалов и презентаций, аудио- и видеоконтент, а так же тесты, проверяемые задания, задания для совместной работы.

система тестирования Indigo (<https://indigotech.ru/>).

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

1. Лекционные занятия - аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер/ноутбук) с соответствующим программным обеспечением, меловой (и) или маркерной доской.
2. Занятий семинарского типа (практические занятия) - аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер/ноутбук) с соответствующим программным обеспечением, меловой (и) или маркерной доской.
3. Самостоятельная работа - аудитория для самостоятельной работы, оснащенная компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет», обеспеченная доступом в электронную информационно-образовательную среду университета. Помещения Научной библиотеки ПГНИУ.
4. Текущий контроль и промежуточная аттестация - аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран, компьютер/ноутбук) с соответствующим программным обеспечением, меловой (и) или

маркерной доской.

Для групповых и индивидуальных консультаций - аудитория, оснащенная компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет», обеспеченная доступом в электронную информационно-образовательную среду университета

Помещения научной библиотеки ПГНИУ для обеспечения самостоятельной работы обучающихся:

1. Научно-библиографический отдел, корп.1, ауд. 142. Оборудован 3 персональными компьютерами с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

2. Читальный зал гуманитарной литературы, корп. 2, ауд. 418. Оборудован 7 персональными компьютерами с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

3. Читальный зал естественной литературы, корп.6, ауд. 107а. Оборудован 5 персональными компьютерами с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

4. Отдел иностранной литературы, корп.2 ауд. 207. Оборудован 1 персональным компьютером с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

5. Библиотека юридического факультета, корп.9, ауд. 4. Оборудована 11 персональными компьютерами с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

6. Читальный зал географического факультета, корп.8, ауд. 419. Оборудован 6 персональными компьютерами с доступом к локальной и глобальной компьютерным сетям.

Все компьютеры, установленные в помещениях научной библиотеки, оснащены следующим программным обеспечением:

Операционная система ALT Linux;

Офисный пакет Libreoffice.

Справочно-правовая система «КонсультантПлюс»

**Фонды оценочных средств для аттестации по дисциплине
Управление рисками**

**Планируемые результаты обучения по дисциплине для формирования компетенции и
критерии их оценивания**

Компетенция	Планируемые результаты обучения	Критерии оценивания результатов обучения
<p>ПК.11 уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании</p>	<p>Знать структуру рискованного события, характеристику его основных элементов; классификацию рисков, связанных с ведением предпринимательской деятельности; показатели риска; основные методы анализа риска; основные процедуры и методы управления риском; структуру риск-менеджмента, характеристику его основных элементов; организационные особенности службы управления рисками в различных хозяйственных структурах; Уметь: идентифицировать наличие (отсутствие) рискованного события в деятельности организации; производить расчет и оценку величины предпринимательского риска, определять целесообразность реализации рискованного мероприятия; обосновывать выбор процедур и методов риск-менеджмента для снижения величины риска; Владеть навыками использования инструментов риск-менеджмента в процессе анализа, обоснования и принятия управленческих решений в организации.</p>	<p align="center">Неудовлетворител</p> <p>Отсутствие знаний Не знает основ дисциплины, необходимых при формировании компетенции Отсутствие умений Отсутствие навыков</p> <p align="center">Удовлетворительн</p> <p>Общие, но не структурированные знания основ методологии и техниках управления рисками в деятельности предприятий (фирм) Частично сформированное умение, связанное с развитием у студентов аналитических способностей по принятию эффективных оперативных/стратегических решений с учетом рисков внешней и внутренней среды предприятия.</p> <p align="center">Хорошо</p> <p>Сформированные, но содержащие отдельные пробелы знания о методологии и техниках управления рисковой составляющей деятельности предприятий (фирм), не в полном объеме получены профессиональные навыки, связанные с развитием у студентов аналитических способностей по принятию эффективных оперативных/тактических/стратегических решений с учетом рисков внешней и внутренней среды предприятия.</p> <p align="center">Отлично</p> <p>Сформированные систематические знания о методологии и техниках управления рисками в деятельности предприятий (фирм), получены профессиональные навыки, связанные с развитием у студентов аналитических способностей по принятию эффективных оперативных/тактических/стратегических</p>

Компетенция	Планируемые результаты обучения	Критерии оценивания результатов обучения
		Отлично решений с учетом рисков внешней и внутренней среды предприятия.

Оценочные средства текущего контроля и промежуточной аттестации

Схема доставки : Базовая

Вид мероприятия промежуточной аттестации : Экзамен

Способ проведения мероприятия промежуточной аттестации : Оценка по дисциплине в рамках промежуточной аттестации определяется на основе баллов, набранных обучающимся на контрольных мероприятиях, проводимых в течение учебного периода.

Максимальное количество баллов : 100

Конвертация баллов в отметки

«отлично» - от 81 до 100

«хорошо» - от 61 до 80

«удовлетворительно» - от 50 до 60

«неудовлетворительно» / «незачтено» менее 50 балла

Компетенция	Мероприятие текущего контроля	Контролируемые элементы результатов обучения
Входной контроль	Введение в дисциплину "Управление рисками" Входное тестирование	Знание об основных предположениях соотношения риска и доходности, функции сложных процентов, методов расчета основных показателей эффективности финансового и инвестиционного менеджмента; Уметь обосновывать управленческие решения на основе соотношения затраты/доходы, применять на практике функции сложных процентов, методы расчета основных показателей эффективности финансового и инвестиционного менеджмента; Владеть навыками применения на практике обоснования управленческих решений на основе соотношения затраты/доходы, применения на практике функций сложных процентов, методов расчета основных показателей эффективности финансового и инвестиционного менеджмента;

Компетенция	Мероприятие текущего контроля	Контролируемые элементы результатов обучения
<p>ПК.11 уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании</p>	<p>Тема 3. Стратегии решений в условиях риска Письменное контрольное мероприятие</p>	<p>Знать сущность аналитических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия. Игровые модели. Метод анализа целесообразности затрат. Методы расчета и анализа основных показателей финансово-хозяйственной деятельности предприятия. Модели по определению и оценке риска банкротства предприятия. Дерево решений. Уметь применять аналитические методы и моделей определения и оценки рисков предприятия при планировании управления рисками. Владеть аналитическими методами и моделями определения и оценки рисков предприятия при принятии управленческих решений</p>
<p>ПК.11 уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании</p>	<p>Тема 5. Оценка экономического эффекта от управления рисками Письменное контрольное мероприятие</p>	<p>Знать особенности применения методики избежания и лимитирования рисков. Внутренние меры и разработку системы нормативов. Диверсификация, ее основные направления. Общую характеристику и способы осуществления передачи и хеджирование рисков. Этапы планирования реагирования на риски. Уметь применять методы управления рисками и осуществлять выбор процедур контроля. Владеть навыками разработки плана противодействия появлению рисков и снижения их величины, осуществления мониторинга и контроля рисков.</p>

Компетенция	Мероприятие текущего контроля	Контролируемые элементы результатов обучения
<p>ПК.11 уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании</p>	<p>Тема 7. Анализ и управление валютным риском и риском процентной ставки Письменное контрольное мероприятие</p>	<p>Знать: виды рыночных рисков. Волатильность и способы ее моделирования. Структуру валютного риска. Своп-риск. Риск фиксированной процентной ставки (риск ФПС), риск плавающей процентной ставки (риск ППС). Основные подходы к анализу и количественной оценке риска процентной ставки. Инструменты управления риском процентной ставки. Уметь применять основные подходы к анализу и количественной оценке риска процентной ставки. Владеть основными подходами к анализу и количественной оценке риска и инструментами управления риском процентной ставки.</p>
<p>ПК.11 уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании</p>	<p>Тема 8. Анализ и управление риском ликвидности и риском инвестиционных проектов. Анализ чувствительности проекта Итоговое контрольное мероприятие</p>	<p>Знать понятие риска ликвидности, источники его возникновения. Основные направления минимизации риска ликвидности. Профиль риска инвестиционных проектов, источники их возникновения. Методы анализа и оценки рисков инвестиционных проектов. Механизмы управления рисками инвестиционных проектов. Уметь: идентифицировать риски ликвидности, риски инвестиционных проектов. Выявлять их возникновения. Методы анализа и оценки . Владеть методами идентификации и оценки рисков ликвидности и рисков инвестиционных проектов, а также механизмами управления данными рисками.</p>

Спецификация мероприятий текущего контроля

Введение в дисциплину "Управление рисками"

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **1 часа**

Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**

Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **0**

Проходной балл: **0**

Показатели оценивания	Баллы
Обладает знаниями основной терминологии, методов и подходов финансового менеджмента, экономики предприятия Демонстрирует умения применять на практике методы выбора наиболее эффективного способа вложения средств, методы оценки доходности демонстрирует навыки применения методов выбора наиболее эффективного способа вложения средств, методами оценки доходности инвестиций	5
В целом успешные, но содержащие некоторые пробелы, знания основной терминологии, методов и подходов финансового менеджмента, экономики предприятия В целом успешные, но содержащие некоторые пробелы, умения применять на практике методы выбора наиболее эффективного способа вложения средств, методы оценки доходности В целом успешные, но содержащие некоторые пробелы, навыки применения методов выбора наиболее эффективного способа вложения средств, методами оценки доходности инвестиций	4
Фрагментарные знания основной терминологии, методов и подходов финансового менеджмента, экономики предприятия Фрагментарно умеет применять на практике методы выбора наиболее эффективного способа вложения средств, методы оценки доходности Частично владеет методами выбора наиболее эффективного способа вложения средств, методами оценки доходности инвестиций	2
Не знает основную терминологию, методы и подходы финансового менеджмента, экономики предприятия не умеет: применять на практике методы выбора наиболее эффективного способа вложения средств, методы оценки доходности не владеет методами выбора наиболее эффективного способа вложения средств, методами оценки доходности инвестиций	0

Тема 3. Стратегии решений в условиях риска

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **2 часа**

Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**

Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **20**

Проходной балл: **10**

Показатели оценивания	Баллы
Решена 1 практическая задача правильно с соблюдением установленной методики расчёта показателей, решение характеризуется арифметической точностью вычисления показателей, даны выводы по полученным результатам	5
Решена 1 практическая задача правильно с соблюдением установленной методики расчёта показателей, решение характеризуется арифметической точностью вычисления показателей, но не даны выводы по полученным результатам	4
1 практическая задача решена неправильно, без соблюдением установленной методики расчёта показателей, не даны выводы по полученным результатам	2
1 практическая задача не решена	0

Тема 5. Оценка экономического эффекта от управления рисками

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **2 часа**

Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**

Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **20**

Проходной балл: **10**

Показатели оценивания	Баллы
Решена 1 практическая задача правильно с соблюдением установленной методики расчёта показателей, решение характеризуется арифметической точностью вычисления показателей, даны выводы по полученным результатам	5
Решена 1 практическая задача правильно с соблюдением установленной методики расчёта показателей, решение характеризуется арифметической точностью вычисления показателей, но не даны выводы по полученным результатам	4
1 практическая задача решена неправильно, без соблюдением установленной методики расчёта показателей, не даны выводы по полученным результатам	2
1 практическая задача не решена	0

Тема 7. Анализ и управление валютным риском и риском процентной ставки

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **2 часа**

Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**

Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **20**

Проходной балл: **10**

Показатели оценивания	Баллы
Решена 1 практическая задача правильно с соблюдением установленной методики расчёта показателей, решение характеризуется арифметической точностью вычисления показателей, даны выводы по полученным результатам	5
Решена 1 практическая задача правильно с соблюдением установленной методики расчёта показателей, решение характеризуется арифметической точностью вычисления показателей, но не даны выводы по полученным результатам	4
1 практическая задача решена неправильно, без соблюдением установленной методики расчёта показателей, не даны выводы по полученным результатам	2
1 практическая задача не решена	0

Тема 8. Анализ и управление риском ликвидности и риском инвестиционных проектов.

Анализ чувствительности проекта

Продолжительность проведения мероприятия промежуточной аттестации: **2 часа**

Условия проведения мероприятия: **в часы аудиторной работы**

Максимальный балл, выставляемый за мероприятие промежуточной аттестации: **40**

Проходной балл: **20**

Показатели оценивания	Баллы
------------------------------	--------------

Решена 1 практическая задача правильно с соблюдением установленной методики расчёта показателей, решение характеризуется арифметической точностью вычисления показателей, даны выводы по полученным результатам	5
Решена 1 практическая задача правильно с соблюдением установленной методики расчёта показателей, решение характеризуется арифметической точностью вычисления показателей, но не даны выводы по полученным результатам	4
1 практическая задача решена неправильно, без соблюдением установленной методики расчёта показателей, не даны выводы по полученным результатам	2
1 практическая задача не решена	0