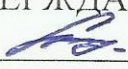


**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Воронежский государственный технический университет»

УТВЕРЖДАЮ
Декан факультета  К.А. Склиаров
«30» августа 2019 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА
дисциплины

«Риск-менеджмент»

Направление подготовки 38.04.01 ЭКОНОМИКА

Программа Экономика инновационных предприятий


Квалификация выпускника магистр

Нормативный период обучения 2 года и 4 м.

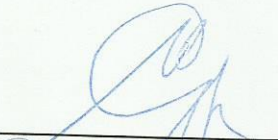
Форма обучения заочная

Год начала подготовки 2019


Автор программы

 / С.С. Уварова /

Заведующий кафедрой
Инноватики и строительной
физики

 / Суровцев И.С. /

Руководитель ОПОП

 / Суровцев И.С. /

Воронеж 2019

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Цели дисциплины

В рамках изучения курса «Риск-менеджмент» предполагается овладение методологией построения и применения математических моделей финансовых операций с учетом фактора риска; освоение типовых методов и моделей, используемых в анализе и оптимизации финансовых операций с учетом факторов риска; освоение технологии выработки решения в условиях финансового риска и неопределенности.

Целью дисциплины «Риск-менеджмент» является формирование системы углублённых знаний, аналитических и практических навыков в области оценки и управления финансовыми рисками компании, и на их основе - умений организации финансовой деятельности.

1.2. Задачи освоения дисциплины

- формирует современное представление о финансовых рисках и финансовом риск-менеджменте при осуществлении корпоративного инвестирования;
- создает основу для понимания стратегии и тактики управления финансовыми рисками;
- способствует изучению существующих методов анализа и оценки финансовых рисков портфельного инвестирования;
- формирует понимание основных инструментов управления финансовыми рисками реального инвестирования и возможностей их снижения;
- способствует выработке практических навыков по управлению финансовыми рисками реального инвестирования.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к дисциплинам вариативной части (дисциплина по выбору) блока Б1.

3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Процесс изучения дисциплины «Риск-менеджмент» направлен на формирование следующих компетенций:

ПК-6 - способностью оценивать эффективность проектов с учетом фактора неопределенности

ПК-7 - способностью разрабатывать стратегии поведения экономических агентов на различных рынках

ПК-9 - способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов

ПК-11 - способностью руководить экономическими службами и подразделениями на предприятиях и организациях различных форм собственности, в органах государственной и муниципальной власти

| Компетенция | Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции |
|-------------------------------|---|
| ПК-6 ПК-7 ПК-9 ПК-11 | <p data-bbox="730 253 826 286">Знать:</p> <ul data-bbox="874 297 1477 1160" style="list-style-type: none"> • сущность, функции и основные принципы организации управления финансовыми рисками предприятия, его методологическое и информационное обеспечение; • виды рисков, возникающих для предприятия; • практику анализа рисков реального инвестирования; • основы организации управления финансовыми рисками портфельного инвестирования; • основную отечественную и зарубежную литературу по теоретическим и практическим вопросам управления финансовыми рисками при формировании инвестиционного портфеля предприятия; <p data-bbox="730 1216 837 1249">Уметь:</p> <ul data-bbox="826 1261 1477 1832" style="list-style-type: none"> • применять методики оценки и управления рисками; • применять методы формирования и управления инвестиционным портфелем предприятия с учетом его финансовых рисков; • использовать современные методики оценки эффективности инвестиционного портфеля предприятия и его финансовых рисков на практике; • использовать современное программное обеспечение для разработки и реализации управленческих решений, а также оценки их эффективности. <p data-bbox="730 1888 866 1921">Владеть:</p> <ul data-bbox="826 1933 1477 2063" style="list-style-type: none"> • навыками оценки финансовых рисков реального инвестирования; • навыками управления |

| | |
|--|--|
| | финансовыми рисками инвестиционного проекта; <ul style="list-style-type: none"> • навыками оценки финансовых рисков при осуществлении портфельного инвестирования; • навыками управления финансовыми рисками предприятия. |
|--|--|

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Риск-менеджмент» составляет 4 з.е.

Распределение трудоемкости дисциплины по видам занятий

заочная форма обучения

| Виды учебной работы | Всего часов | Семестр ы |
|---|-------------|--------------|
| | | 1 |
| Аудиторные занятия (всего) | 60 | 30 |
| В том числе: | | |
| Лекции | 24 | 12 |
| Практические занятия (ПЗ) | 36 | 18 |
| Самостоятельная работа | 220 | 110 |
| Часы на контроль | 8 | 4 |
| Виды промежуточной аттестации - зачет с оценкой | + | + |
| Общая трудоемкость: академические часы | 144 | 144 |
| зач.ед. | 4 | 4 |

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

5.1 Содержание разделов дисциплины и распределение трудоемкости по видам занятий

заочная форма обучения

| № п/п | Наименование темы | Содержание раздела | Лекц | Пра к зан. | СРС | Всего, час |
|-------|---------------------------------------|---|------|------------------|-----|---------------|
| 1 | Основы управления финансовыми рисками | Финансовый риск-менеджмент: исторические предпосылки. | 2 | 3 | 18 | 23 |
| 2 | Основы управления финансовыми рисками | Финансовые риски реального и портфельного инвестирования Задачи управления финансовым риском в современных условиях. | 2 | 3 | 18 | 23 |
| 3 | Основы управления финансовыми рисками | Управление финансовыми рисками: основные принципы и методы. Функции и механизм управления финансовыми рисками компании. | 2 | 3 | 18 | 23 |
| 4 | Основы управления финансовыми рисками | Процесс управления финансовыми рисками организации. Основные этапы процесса управления финансовыми рисками. | 2 | 3 | 18 | 23 |

| | | | | | | |
|----|--|---|---|---|----|----|
| 5 | Основные методы оценки финансовых рисков предприятия | Идентификация и качественные методы оценки рисков. SWOT-анализ. | 2 | 3 | 18 | 23 |
| 6 | Основные методы оценки финансовых рисков предприятия | Количественный анализ рисков Сценарный подход. | 2 | 3 | 18 | 23 |
| 7 | Основные методы оценки финансовых рисков предприятия | Имитационное моделирование. Количественная оценка рисков портфельного инвестирования. | 2 | 3 | 18 | 23 |
| 8 | Основные методы оценки финансовых рисков предприятия | Показатель потенциальных потерь портфеля (VaR): достоинства и недостатки. Альтернативные и дополнительные показатели Shortfall, HEAD. | 2 | 3 | 18 | 23 |
| 9 | Процесс управления финансовыми рисками предприятия | Понятие дюрации проекта. Оценка устойчивости проекта к базовым параметрам реализации (анализ операционной, денежной и финансовой устойчивости). Вероятностный анализ денежных потоков по проекту: влияние на оценку проекта, правила расчета дисперсии NPV при зависимых и независимых по годам денежных потоках проекта (дисперсия портфеля денежных потоков). | 2 | 3 | 19 | 24 |
| 10 | Процесс управления финансовыми рисками предприятия | Два принципиальных метода включения риска в анализ проекта методом NPV: использование ставки дисконтирования, скорректированной на риск (RADR), и метод гарантированных эквивалентных потоков денежных средств (метод риск-нейтрального денежного потока, certainty equivalents или CE). Метод затрат на капитал. Управление кредитным риском. Управление риском ликвидности. Управление процентным риском. Методы управления процентным риском: дисбалансом (ГЭП), дюрацией активов и пассивов. Расчет чувствительности для портфеля чувствительных к процентному риску активов и пассивов. Методы иммунизации по отношению к изменению уровня процентных ставок Управление валютным риском. Управление агрегированными финансовыми рисками инвестиционной деятельности. | 2 | 3 | 19 | 24 |
| 11 | Методы снижения финансовых рисков предприятия | Финансовые составляющие процесса управления рисками. Мероприятия по снижению финансовых рисков корпоративного инвестирования. Перенос риска. Страхование. Хеджирование рисков. Кредитные производные. Хеджирование кредитного риска. Хеджирование срочными процентными контрактами как метод снижения процентного риска. Хеджирование срочными валютными контрактами как метод снижения валютного риска. Уменьшение негативных последствий. Резервирование. | 2 | 3 | 19 | 24 |
| 12 | Методы снижения финансовых рисков | Создание и использование резерва | 2 | 3 | 19 | 24 |

| | | | | | | |
|--------------|-------------|---|-----------|-----------|------------|------------|
| | предприятия | непредвиденных расходов и потерь. Система лимитов как инструмент ограничения риска портфеля ценных бумаг. Виды лимитов. Лимит общего риска портфеля и структурные лимиты. Лимиты на эмитентов ценных бумаг. Позиционные лимиты. Лимиты «стоп-лосс» и «тэйк-профит». Принципы установления лимитов. Контроль за соблюдением лимитов. | | | | |
| Итого | | | 24 | 36 | 220 | 280 |

5.2 Перечень лабораторных работ

Не предусмотрено учебным планом

6. ПРИМЕРНАЯ ТЕМАТИКА КУРСОВЫХ ПРОЕКТОВ (РАБОТ) И КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ

- 1.Эволюция взглядов на категории «риск».
- 2.Сущность и содержание риск-менеджмента.
- 3.Классификация рисков.
- 4.Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.
- 5.Предпосылки и факторы, предшествующие наступлению рискованных ситуаций.
- 6.Стратегия и тактика риск-менеджмента.
- 7.Анализ и оценка уровня риска.
- 8.Пороговые значения риска.
- 9.Проблемы сравнительной оценки вариантов решений с учетом риска.
- 10.Статистические методы оценки риска.
- 11.Экспертные процедуры и методы субъективных оценок при измерении риска.
- 12.Прогнозирование рисков.
- 13.Методы уклонения от риска и его компенсации.

14. Хеджирование рисков.
15. Страхование рисков.
16. Аутсорсинг управления риском.
17. Организация управления риском на производственном предприятии.
18. Этапы управления риском на производственном предприятии.
19. Принципы информационного обеспечения системы управления риском.
20. Психологические аспекты принятия решений в рискованных ситуациях

7. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

7.1. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

7.1.1 Этап текущего контроля

Результаты текущего контроля знаний и межсессионной аттестации оцениваются по следующей системе:

«аттестован»;

«не аттестован».

| Компетенция | Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции | Критерии оценивания | Аттестован | Не аттестован |
|-------------------------------|---|---------------------|---|---|
| ПК-6 ПК-7 ПК-9 ПК-11 | <p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> сущность, функции и основные принципы организации управления финансовыми рисками предприятия, его методологическое и информационное обеспечение; виды рисков, возникающих для предприятия; практику анализа рисков реального инвестирования; основы организации управления финансовыми рисками портфельного инвестирования; основную отечественную и зарубежную литературу по теоретическим и | Тест | Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах | Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах |

| | | | | |
|--|---|--|---|---|
| | практическим вопросам управления финансовыми рисками при формировании инвестиционного портфеля предприятия; | | | |
| | <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> • применять методики оценки и управления рисками; • применять методы формирования и управления инвестиционным портфелем предприятия с учетом его финансовых рисков; • использовать современные методики оценки эффективности инвестиционного портфеля предприятия и его финансовых рисков на практике; • использовать современное программное обеспечение для разработки и реализации управленческих решений, а также оценки их эффективности. | Решение стандартных практических задач | Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах | Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах |
| | <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> • навыками оценки финансовых рисков реального инвестирования; • навыками управления финансовыми рисками инвестиционного проекта; • навыками оценки финансовых рисков при осуществлении портфельного инвестирования; • навыками управления финансовыми рисками предприятия. | Решение прикладных задач в конкретной предметной области | Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах | Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах |

7.1.2 Этап промежуточного контроля знаний

Результаты промежуточного контроля знаний оцениваются в 0, 1 семестре для очной формы обучения по четырехбалльной системе:

«отлично»;

«хорошо»;

«удовлетворительно»;

«неудовлетворительно».

| Компетенция | Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции | Критерии оценивания | Отлично | Хорошо | Удовл. | Неудовл. |
|-------------------------------|--|---------------------|------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| ПК-6 ПК-7 ПК-9 ПК-11 | <p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> • сущность, функции и основные принципы организации управления | Тест | Выполнение теста на 90- 100% | Выполнение теста на 80- 90% | Выполнение теста на 70- 80% | В тесте менее 70% правильных ответов |

| | | | | | | |
|----------|--|--|--|---|--|------------------|
| | <p>финансовыми рисками предприятия, его методологическое и информационное обеспечение;</p> <ul style="list-style-type: none"> • виды рисков, возникающих для предприятия; • практику анализа рисков реального инвестирования; • основы организации управления финансовыми рисками портфельного инвестирования; • основную отечественную и зарубежную литературу по теоретическим и практическим вопросам управления финансовыми рисками при формировании инвестиционного портфеля предприятия; | | | | | |
| Уметь: | <ul style="list-style-type: none"> • применять методики оценки и управления рисками; • применять методы формирования и управления инвестиционным портфелем предприятия с учетом его финансовых рисков; • использовать современные методики оценки эффективности инвестиционного портфеля предприятия и его финансовых рисков на практике; • использовать современное программное обеспечение для разработки и реализации управленческих решений, а также оценки их эффективности. | Решение стандартных практических задач | Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы | Продемонстрирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах | Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач | Задачи не решены |
| Владеть: | <ul style="list-style-type: none"> • навыками оценки финансовых рисков реального инвестирования; | Решение прикладных задач в конкретной | Задачи решены в полном объеме и | Продемонстрирован верный ход решения | Продемонстрирован верный ход решения в | Задачи не решены |

| | | | | | |
|--|--------------------|------------------------|--|-------------------|--|
| <ul style="list-style-type: none"> • навыками управления финансовыми рисками инвестиционного проекта; • навыками оценки финансовых рисков при осуществлении портфельного инвестирования; • навыками управления финансовыми рисками предприятия. | предметной области | получены верные ответы | всех, но не получен верный ответ во всех задачах | большинстве задач | |
|--|--------------------|------------------------|--|-------------------|--|

7.2 Примерный перечень оценочных средств (типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности)

7.2.1 Примерный перечень заданий для подготовки к тестированию

1. Понятие финансовый риск:

- а) определено законодательством
- б) включает в себя предпринимательский риск
- в) связано с дополнительными финансовыми расходами
- г) все ответы верны

2. Риск концентрации кредитного портфеля коммерческого банка связан с:

- а) проявлением недобросовестности в процессе работы с кредитами
- б) плохим финансовым положением заемщика
- в) отсутствием источников возврата средств
- г) предоставлением крупных кредитов одному заемщику

3. Инструментом регулирования рыночных рисков является:

- а) установка лимитов по финансовым инструментам
- б) оперативная оценка состояния валютного рынка
- в) оба ответа верны
- г) нет верного ответа

4. Риски профессиональной деятельности учетных институтов связаны с:

- а) утратой хранимых ценных бумаг
- б) неправомерным предоставлением конфиденциальной информации
- в) оба ответа верны
- г) нет верного ответа

5. В качестве основного метода управления рисками учетные институты используют:

- а) лимитирование
- б) хеджирование
- в) диверсификацию
- г) нет верного ответа

6. Риски ПУФР:

- а) включают риски, возникающие в рамках ведения хоз. деятельности
- б) относятся полностью к спекулятивным рискам
- в) не включают естественно-природные риски
- г) все ответы верны

7. Основные принципы управления рисками:

- а) нельзя рисковать больше, чем могут позволить заемные средства
- б) в отдельных случаях можно рисковать многим ради малого
- в) необходимо думать о последствиях риска
- г) нет верного ответа

8. Основными методами управления кредитным риском являются :

- а) оценка финансового состояния заемщиков
- б) резервирование
- в) разграничение полномочий сотрудников
- г) все ответы верны

9. Основными методами управления фондовым риском являются:

- а) оценка финансового состояния эмитента
- б) установление лимитов на эмитентов ценных бумаг
- в) установка лимитов на операции с ценными бумагами
- г) все ответы верны

10. Нормативно-правовое регулирование операционного риска в

- а) коммерческом банке осуществляется:
- б) рекомендациями ЦБ РФ
- в) рекомендациями Базельского комитета по банковскому надзору
- г) собственными внутренними документами банка
- д) все ответы верны

11. Объект управления в риск-менеджменте:

- а) финансовые отношения в процессе реализации риска
- б) рискованные вложения капитала
- в) оба ответа верны
- г) нет верного ответа

7.2.2 Примерный перечень заданий для решения стандартных задач

Не предусмотрено учебным планом

7.2.3 Примерный перечень заданий для решения прикладных задач

Не предусмотрено учебным планом

7.2.4 Примерный перечень вопросов для подготовки к зачету

1. Понятие финансовых рисков и их классификация.
2. Основные принципы и методы управления финансовыми рисками:.
3. Функции и механизм управления финансовыми рисками предприятия.
4. Основные этапы процесса управления финансовыми рисками.
5. Учет фактора инфляции в процессе управления риском.
6. Вероятностно-статистический подход к описанию рисков. Стохастические модели динамики рыночных цен.
7. Портфельный эффект: диверсификация и снижение риска.
8. Систематические и несистематические финансовые риски.
9. Финансовые составляющие процесса управления рисками.
10. Страхование в системе управления рисками на предприятии.

11. Управление кредитным риском.
12. Управление риском ликвидности. Ликвидность рынка.
13. Управление процентным риском. Содержание, значение и факторы процентного риска.
14. Методы управления процентным риском.
15. Управление валютным риском. Содержание, факторы и виды валютного риска.
16. Методы управления валютным риском.
17. Управление агрегированными финансовыми рисками инвестиционной деятельности.
18. Риски и диверсификация инвестиционного портфеля.
19. Система лимитов как инструмент ограничения риска портфеля ценных бумаг.
20. Виды лимитов и принципы их установления.
21. Показатель потенциальных потерь портфеля VaR: достоинства и недостатки.
22. Использование показателя VaR для измерения рыночных рисков.
23. Показатель риска VaR для индивидуального инструмента и портфеля.
24. Альтернативные и дополнительные показатели.
25. Показатели чувствительности.
26. Коэффициент β в модели CAPM.
27. Метод сценариев. Стресс-тестирование.
28. Бэк-тестинг.
29. Особенности измерения и управления рисками в условиях низкой ликвидности рынка.
30. Временная структура ставок процента и ее модели.
31. Дюрация. Дюрация и чувствительность к ставке процента.
32. Выпуклость. Применение анализа выпуклости.
33. Риск ставки реинвестирования. Иммунизация.
34. Детерминанты кредитного качества. Фундаментальные источники риска.
35. Риск процентной ставки. Чувствительность к компонентам риска.
36. Свопы облигаций.
37. Хеджирование, его экономическая целесообразность. Расчет коэффициентов хеджа.
38. Кредитные производные. Хеджирование кредитного риска.
39. Стратегии ликвидации портфеля.
40. Ликвидация позиций с использованием хеджирования на основе доступных производных финансовых инструментов.
41. Источники риска при реализации инвестиционного проекта и их классификация.
42. Стадии жизненного цикла и риски, им сопутствующие.
43. Этапы и организация риск-менеджмента инвестиционного проекта.
44. Классификация проектных рисков.
45. Оценка и анализ выявленных проектных рисков.
46. Идентификация и мониторинг проектных рисков.

47. Анализ чувствительности инвестиционного проекта.
48. Сущность качественного анализа проектных рисков.
49. Методы качественного анализа проектных рисков.
50. Методы количественного анализа проектных рисков.
51. Сценарный подход к оценке рисков реального инвестирования.
52. Метод имитационного моделирования.
53. Риски, связанные с проектированием, и основные способы противодействия им.
54. Понятие дюрации проекта.
55. Оценка устойчивости проекта к базовым условиям реализации.
56. Вероятностный анализ денежных потоков по проекту.
57. Способы включения риска в анализе проекта методом NPV.
58. Варианты корректировки денежных потоков методом гарантированного эквивалента.
59. Коэффициенты бета денежных потоков и бета доходности, их взаимосвязь для проекта.
60. Использование модели CAPM при оценке денежных потоков по проекту.
61. Особенности обоснования ставки дисконта при анализе эффективности проекта.
62. Построение графика предельных затрат на капитал (MCC).
63. Особенность проектов снижения издержек.
64. Ранжирование проектов по группам риска и кумулятивный метод формирования ставки дисконта.
65. Классификация рисков, возникающих на инвестиционной фазе реализации инвестиционного проекта
66. Риски, связанные с заключением договоров на производство строительно-монтажных работ и поставку оборудования.
67. Мониторинг реализации проекта.
68. Обеспечение своевременности финансирования работ как необходимое условие планового завершения инвестиционной фазы.
69. Риски эксплуатационной фазы реализации инвестиционного проекта.
70. Постаудит проектных рисков.
71. Необходимость мониторинга показателей проекта с целью своевременного обнаружения возникающих рисков.
72. Классификация мероприятий по снижению рисков.
73. Соответствие рисков и способов их снижения.
74. Возможности применения хеджирования при реализации инвестиционных проектов.

7.2.5 Примерный перечень заданий для решения прикладных задач Не предусмотрено учебным планом

7.2.6. Методика выставления оценки при проведении промежуточной аттестации

7.2.7 Паспорт оценочных материалов

| № п/п | Контролируемые разделы (темы) дисциплины | Код контролируем ой компетенции | Наименование оценочного средства |
|----------|---|--|---|
| 1 | Основы управления финансовыми рисками | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 2 | Основы управления финансовыми рисками | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 3 | Основы управления финансовыми рисками | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 4 | Основы управления финансовыми рисками | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 5 | Основные методы оценки финансовых рисков предприятия | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 6 | Основные методы оценки финансовых рисков предприятия | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 7 | Основные методы оценки финансовых рисков предприятия | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 8 | Основные методы оценки финансовых рисков предприятия | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к |

| | | | |
|----|--|-------------------------|--|
| | | | курсовому проекту.... |
| 9 | Процесс управления финансовыми рисками предприятия | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 10 | Процесс управления финансовыми рисками предприятия | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 11 | Методы снижения финансовых рисков предприятия | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |
| 12 | Методы снижения финансовых рисков предприятия | ПК-6, ПК-7, ПК-9, ПК-11 | Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту.... |

7.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

Зачет может проводиться по итогам текущей успеваемости и сдачи курсовой работы и (или) путем организации специального опроса, проводимого в устной и (или) письменной форме.

Во время проведения экзамена (зачета) обучающиеся могут пользоваться программой дисциплины, а также вычислительной техникой.

8 УЧЕБНО МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ)

8.1 Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

Основная литература:

1. Балдин К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2016.— 420 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/14110>

2. Казакова, Н. А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски [Текст] : учеб. пособие : рек. УМО / Н. А.

Казакова. - М. : Инфра-М, 2016 (Смоленск : ОАО "Смол. обл. тип. им. В. И. Смирнова", 2016). - 207 с. - (Высшее образование). - Библиогр.: с. 204 (21 назв.). - ISBN 978-5-16-004578-8 : 165-00.

3. Шапкин, Александр Сергеевич, Шапкин, Виктор Александрович
Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: учебник для вузов :
допущено МО РФ. - 4-е изд.. - М. : Дашков и К, 2016 -879 с.

Дополнительная литература:

1. Иванов А.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Иванов А.А., Олейников С.Я., Бочаров С.А.— Электрон. текстовые данные.— М.: Евразийский открытый институт, 2015.— 304 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10817>.

2. Титаренко Б.П. Управление рисками в инновационных проектах [Электронный ресурс]: монография/ Титаренко Б.П.— Электрон. текстовые данные.— М.: Московский государственный строительный университет, ЭБС АСВ, 2015.— 144 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/16322>.

8.2 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень лицензионного программного обеспечения, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

1. Microsoft Excel;
2. «Строй Консультант»;
3. Правовая система «Гарант»;
4. Интернет.

9 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКАЯ БАЗА, НЕОБХОДИМАЯ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА

Материально-техническое обеспечение дисциплины включает:

- лекционную аудиторию, оборудованную экраном для показа слайдов через проектор;
- специализированные классы, оснащенные персональными компьютерами с выходом в интернет.

10. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Изучение дисциплины складывается из следующих элементов:

- лекции по дисциплине в соответствии с рабочей программой и календарным планом;

- практические занятия;
- самостоятельное изучение проблем, вынесенных на лекционных и практических занятиях;
- самостоятельное изучение отдельных вопросов, не включенных в содержание лекционных и практических занятий;
- подготовка к текущему и промежуточному контролю знаний;
- подготовка к итоговому экзамену.

Подготовка к практическим занятиям и самостоятельное изучение отдельных рекомендуемых к изучению вопросов осуществляется с использованием:

- лекционных материалов;
- рекомендуемой литературы;
- периодических изданий;
- сети «Интернет».

| Вид учебных занятий | Деятельность студента |
|----------------------------|--|
| Лекция | Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначение вопросов, терминов, материала, которые вызывают трудности, поиск ответов в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на лекции или на практическом занятии. |
| Практическое занятие | Конспектирование рекомендуемых источников. Работа с конспектом лекций, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы. Прослушивание аудио- и видеозаписей по заданной теме, выполнение расчетно-графических заданий, решение задач по алгоритму. |
| Самостоятельная работа | Самостоятельная работа студентов способствует глубокому усвоению учебного материала и развитию навыков самообразования. Самостоятельная работа предполагает следующие составляющие: <ul style="list-style-type: none"> - работа с текстами: учебниками, справочниками, дополнительной литературой, а также проработка конспектов лекций; - выполнение домашних заданий и расчетов; - работа над темами для самостоятельного изучения; - участие в работе студенческих научных конференций, олимпиад; - подготовка к промежуточной аттестации. |
| Подготовка к промежуточной | Готовиться к промежуточной аттестации следует |

| | |
|------------|--|
| аттестации | систематически, в течение всего семестра. Интенсивная подготовка должна начаться не позднее, чем за месяц-полтора до промежуточной аттестации. Данные перед зачетом с оценкой, зачетом с оценкой три дня эффективнее всего использовать для повторения и систематизации материала. |
|------------|--|