

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«ИНГУШСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**ФАКУЛЬТЕТ ЭКОНОМИКИ И УПРАВЛЕНИЯ**

УТВЕРЖДАЮ  
И.о. проректора по учебной работе  
\_\_\_\_\_ Ф.Д. Кодзоева  
«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**  
Б1.В.ДВ.04.01. Риск-менеджмент государственного-частном партнерстве  
(наименование дисциплины)

**Направление подготовки**  
38.04.02 «Менеджмент»

**Магистерская программа**  
«Государственно-частное партнёрство»

**Квалификация выпускника**  
Магистр

Форма обучения  
очная, заочная

Магас, 2022

## 1. Цели и задачи освоения учебной дисциплины

**Цель** – Дать представление о современных подходах к построению системы риск – менеджмента на современных предприятиях (организациях), способствовать приобретению навыков в использовании методов управления рисками при решении практических задач.

### **Задачи:**

Дать представления о современной парадигме риск-менеджмента и современных подходов к развитию этой дисциплине; Познакомить с фундаментальными основами и принципами, на которых строится риск-менеджмент. Сформировать представления о современных способах сознания систем по управлению рисками. Дать анализ современных проблем риск-менеджмента и подходов к их решению в российских и зарубежных экономических школах

## 2. Место учебной дисциплины в структуре опово

Дисциплина «Риск-менеджмент в государственно-частном партнерстве» относится к дисциплинам по выбору вариативной части Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана.

В соответствии с учебным планом период обучения по дисциплине – 4-й семестр.

Дисциплина «Риск-менеджмент в государственно-частном партнерстве» в силу занимаемого ей места в ФГОС ВО, ОПОП ВО и учебном плане по направлению подготовки 38.03.04 «Менеджмент» предполагает взаимосвязь с другими изучаемыми дисциплинами.

В качестве «входных» знаний дисциплины «Риск-менеджмент в государственно-частном партнерстве» используются знания и умения, полученные обучающимися при изучении дисциплин «Методы исследований в менеджменте», «Планирование и организация предпринимательской деятельности», «Инвестиционное проектирование в государственно-частном партнерстве».

Дисциплина «Риск-менеджмент в государственно-частном партнерстве в государственно-частном партнерстве» может являться предшествующей при изучении дисциплин «Управление в сфере услуг», «Управление рисками проектов государственно-частного партнерства»

## 3. Результаты, освоения дисциплины (модуля) «Риск-менеджмент в государственно –частном партнерстве»

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование элементов следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО по данному управлению:

Таблица 1.

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикатор достижения компетенции (закрепленный за дисциплиной)	В результате освоения дисциплины обучающийся должен:
ПК-1	способен использовать основные теории мотивации, лидерства и власти для решения управленческих задач, а также для организации групповой работы,	ПК-1.1. основные теории и концепции взаимодействия людей в организации, включая вопросы мотивации, групповой динамики, командообразования, коммуникаций, лидерства и управления конфликтами;	<b>Знать:</b> основные теории и концепции взаимодействия людей в организации, включая вопросы мотивации, групповой динамики, командообразования, коммуникаций, лидерства и управления конфликтами

	<p>проектирования межличностных, групповых и организационных коммуникаций на основе современных технологий управления персоналом, в том числе в межкультурной среде</p>		<p><b>Уметь:</b> анализировать коммуникационные процессы в организации и разрабатывать предложения по повышению их эффективности  <b>Владеть:</b> Владеет навыками организации групповой работы, групповых организационных коммуникаций на основе современных технологий управления и его связь со стратегическими задачами организации и разрабатывает предложения по повышению их эффективности</p>
<p><b>ПК-2</b></p>	<p>Способностью разрабатывать корпоративную стратегию, программы организационного развития и изменений и обеспечивать их реализацию</p>	<p>ПК-2.1 Выполняет и обосновывает необходимые для составления экономических разделов плановые расчеты</p>	<p><b>Знать</b> концептуальные основы формирования корпоративной стратегии и программ организационного развития; модели организационных преобразований и стратегических изменений.  <b>Уметь</b> ставить стратегические цели, выбирать пути их достижения на основе комплексного стратегического анализа; при разработке корпоративной стратегии и программ организационного развития генерировать новые идеи в соответствии с отраслевой спецификой  <b>Владеть</b> навыками обоснования выбранной стратегии и разработки программ развития и организационных изменений, генерировать</p>

		новые идеи в соответствии с отраслевой спецификой; механизмами реализации корпоративной стратегии и программ организационных преобразований

#### 4. Структура и содержание дисциплины «Риск-менеджмент в государственно-частном партнерстве»

##### 4.1. Структура дисциплины (модуля)

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачетных единиц, 180 часов

Таблица 2. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических или астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Виды учебных занятий	Трудоемкость		
	зач. ед.	час.	в семестре
			4
<i>гр.1</i>	<i>гр.2</i>	<i>гр.3</i>	<i>гр.4</i>
<b>ОБЩАЯ</b> трудоемкость по учебному плану	<b>5</b>	<b>180</b>	<b>180</b>
<b>Контактные часы</b>	<b>1,16</b>	<b>48</b>	<b>48</b>
Лекции (Л)		24	24
Семинары (С)		0	0
Практические занятия (ПЗ)		24	24
Лабораторные работы (ЛР)		0	0
Групповые консультации (ГК) и (или) индивидуальная работа с обучающимся (ИР), предусмотренные учебным планом подготовки		0	0
<b>Промежуточная аттестация:</b> зачет с оценкой			
<b>Самостоятельная работа (СР)</b> в том числе по курсовой работе (проекту)	<b>5</b>	<b>132</b>	<b>132</b>

##### 4.2. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических или астрономических часов и видов учебных занятий

В данном разделе приводится содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических или астрономических часов и видов учебных занятий. Структура дисциплины по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических или астрономических часов и видов учебных занятий приведена в Таблице 3, содержание дисциплины по темам (разделам) – в Таблице 4.

Таблица 3. Структура дисциплины по темам (разделам) с указанием отведенного на них

количества академических или астрономических часов и видов учебных занятий

№	Наименование темы (раздела)	Количество часов					
		Всего	Контактные часы (аудиторная работа)				СР
			Л	С	ПЗ	ГК/ИК	
<i>гр.1</i>	<i>гр.2</i>	<i>гр.3</i>	<i>гр.4</i>	<i>гр.5</i>	<i>гр.6</i>	<i>гр.7</i>	<i>гр.8</i>
Семестр № 4							
1	Тема 1. Концепция риска и методы его оценки	26	4	4			19
2	Тема 2. Методы идентификации, измерения и картографирования рисков	26	4	4			19
3	Тема 3. Риск-менеджмент - система управления риском	26	4	4			19
4	Тема 4. Стратегия риск-менеджмента	26	4	4			19
5	Тема 5. Риски внешнеэкономической деятельности	26	2	2			19
6	Тема 6. Страхование в управлении рисками	25	2	2			19
7	Тема 7. Методы управления финансовыми рисками	25	4	2			18
<b>Всего</b>		180	24	24	0	0	132
<b>Промежуточная аттестация</b> (зачет с оценкой)							
<b>ИТОГО</b>		180	48				132

Примечание: Л – лекции, С – семинары, ПЗ – практические занятия, ГК/ИК – групповые / индивидуальные консультации

Таблица 4. Содержание дисциплины по темам (разделам)

№	Наименование темы (раздела)	Содержание темы (раздела)
<i>гр.1</i>	<i>гр.2</i>	<i>гр.3</i>
1	Тема 1. Концепция риска и методы его оценки	Понятие неопределенности и риска. Классификация рисков и их видовая специфика. Оценка риска. Отношение к риску. Границы приемлемости риска. Определение степени рисков. Зонирование областей потерь по степени риска. Критерии потерь основных зон риска. Систематический и несистематический риск. Измерение систематического риска, бета-коэффициент. Бета и премия риска. Индекс Трейнора. Линия состояния фондового рынка. Премия риска индивидуального актива. Экспертный метод для оценки вероятности проявления рисков.
2	Тема 2. Методы	Выявление, актуализация, систематизация и анализ

№	Наименование темы (раздела)	Содержание темы (раздела)
<i>гр.1</i>	<i>гр.2</i>	<i>гр.3</i>
	идентификации, измерения и картографирования рисков	рисков. Идентификация источников рисков, оценка и выявление приоритетов риск-факторов при различных процессах управления. Состав и последовательность работ по идентификации и ранжированию рисков. Методы диагностики рисков. Источники сбора информации для идентификации рисков. Графическое представление рисков. Картографирование рисков. Построение карты рисков и рискография. Табличное представление информации в разных стандартах по риск-менеджменту.
3	Тема 3. Риск-менеджмент - система управления риском	Сущность и содержание риск-менеджмента. Разработка программы действий по снижению риска: последовательность стадий. Особенности принятия решений в области риск-менеджмента. Эвристические правила риск-менеджмента и их действие. Коэффициент риска. Организационные структуры службы риск-менеджмента. Процессный подход к риск-менеджменту в организации. Внешний и внутренний мониторинг рисков. Планирование в системе риск-менеджмента.
4	Тема 4. Стратегия риск-менеджмента	Понятие стратегии риск-менеджмента. Основные правила стратегии риск-менеджмента и их действие. Принципы управления риском. Приемы управления риском. Средства разрешения риска. Способы снижения риска. Объединение риска. Самострахование. Страхование.
5	Тема 5. Риски внешнеэкономической деятельности	Структура рисков ВЭД. Понятие странового риска в области международного бизнеса. Разновидности странового риска и их особенности. Факторы, определяющие страновой экономический риск. Качественные методы анализа страновых рисков, проблемы оценки. Сравнительные методы в анализе страновых рисков. Рейтинговые системы в анализе рисков (индекс BERI, рейтинг «Euromoney»). Политические риски в зарубежной коммерческой деятельности, их специфика. Методы управления политическими рисками в международном инвестировании. Риски, связанные с основными положениями внешнеэкономического контракта.
6	Тема 6. Страхование в управлении рисками	Страхование и его место в системе риск-менеджмента. Страхование, как один из методов управления риском, базирующийся на передаче риска. Основные характеристики страхования, как метода управления риском. Классификация рисков. Финансовые и предпринимательские риски. Страхование гражданской ответственности. Виды страхования на рынке РФ и мировом рынке. Особенности покрытия риска в рамках существующих систем страховой ответственности. Франшиза, ее виды,

№	Наименование темы (раздела)	Содержание темы (раздела)
<i>гр.1</i>	<i>гр.2</i>	<i>гр.3</i>
		расчет, влияние на уровень покрытия риска.
7	Тема 7. Методы управления финансовыми рисками	Особенности рынка срочных контрактов и его виды. Особенности риска форвардных сделок. Особенности сделок с опционами, специфика риска. Хеджирование и его роль в снижении риска. Специфика валютного риска. Методы снижения степени валютного риска. Методы страхования валютного риска. Валютные оговорки, их виды, особенности применения. Процентный арбитраж с форвардным покрытием. Роль срочных контрактов в управлении валютным риском.

Таблица 4.1

№	Тема	Для изучения темы, обучающийся должен		
		Знать	Уметь	Владеть
1	Тема 1. Концепция риска и методы его оценки	концептуальные основы руководства коллективом в сфере профессиональной деятельности обеспечивающие толерантное восприятие социальных, этнических, конфессиональных и культурных различий, в том числе с учетом специфики региона проживания	организовывать работу коллектива в сфере профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия, в том числе с учетом специфики региона проживания	навыками организации работы и руководства коллективом с учетом профессиональной специфики, социальных, этнических, конфессиональных и культурных различий, в том числе с учетом специфики региона проживания
2	Тема 2. Методы идентификации, измерения и картографирования рисков	принципы и методы управления организациями, и координацией деятельности сотрудников подразделений, проектных команд, теоретические знания по планированию работы и грамотному	использовать теоретические знания по управлению организациями и подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями в профессиональной деятельности; организовывать и координировать	управленческим инструментарием для управления организациями и подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями в профессиональной деятельности; лидерскими компетенциями для эффективного

		распределению заданий между членами коллектива	деятельность сотрудников и проектных команд; планировать работу и грамотно распределять задания между членами коллектива	управления организациями и подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями
3	Тема 3. Риск-менеджмент - система управления риском	методы сбора и обработки информации в процессе проведения исследования, способы обобщения и оценки результатов исследований, методы и приемы критической оценки результатов исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями	обобщать результаты отечественных и зарубежных исследователей в области актуальных управленческих проблем; определять теоретическое и практическое значение результатов исследований в области управления; осуществлять обработку полученной информации в ходе проводимого исследования отечественными и зарубежными учеными	навыками критической оценки результатов исследований актуальных проблем управления; механизмом обобщения результатов исследований, полученных отечественными и зарубежными учеными в области управления
4	Тема 4. Стратегия риск-менеджмента	концептуальные основы руководства коллективом в сфере профессиональной деятельности обеспечивающие толерантное восприятие социальных, этнических, конфессиональных и культурных различий, в том числе с учетом	организовывать работу коллектива в сфере профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия, в том числе с учетом специфики региона проживания	навыками организации работы и руководства коллективом с учетом профессиональной специфики, социальных, этнических, конфессиональных и культурных различий, в том числе с учетом специфики региона



		специфики региона проживания		проживания
5	Тема 5. Риски внешнеэкономической деятельности	принципы и методы управления организациями, и координацией деятельности сотрудников подразделений, проектных команд, теоретические знания по планированию работы и грамотному распределению заданий между членами коллектива	использовать теоретические знания по управлению организациями и подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями в профессиональной деятельности; организовывать и координировать деятельность сотрудников и проектных команд; планировать работу и грамотно распределять задания между членами коллектива	управленческим инструментарием для управления организациями и подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями в профессиональной деятельности; лидерскими компетенциями для эффективного управления организациями и подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями
6	Тема 6. Страхование в управлении рисками	методы сбора и обработки информации в процессе проведения исследования, способы обобщения и оценки результатов исследований, методы и приемы критической оценки результатов исследований актуальных проблем управления, полученных отечественными и зарубежными исследователями	обобщать результаты отечественных и зарубежных исследователей в области актуальных управленческих проблем; определять теоретическое и практическое значение результатов исследований в области управления; осуществлять обработку полученной информации в ходе проводимого исследования отечественными и	навыками критической оценки результатов исследований актуальных проблем управления; механизмом обобщения результатов исследований, полученных отечественными и зарубежными учеными в области управления

			зарубежными учеными	
7	Тема 7. Методы управления финансовыми рисками	концептуальные основы руководства коллективом в сфере профессиональной деятельности обеспечивающие толерантное восприятие социальных, этнических, конфессиональных и культурных различий, в том числе с учетом специфики региона проживания	организовывать работу коллектива в сфере профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия, в том числе с учетом специфики региона проживания	навыками организации работы и руководства коллективом с учетом профессиональной специфики, социальных, этнических, конфессиональных и культурных различий, в том числе с учетом специфики региона проживания

### 5. Образовательные технологии

Образовательный процесс по дисциплине организован в форме учебных занятий (контактная работа (аудиторной и внеаудиторной) обучающихся с преподавателем и самостоятельная работа обучающихся). Учебные занятия представлены следующими видами, включая учебные занятия, направленные на проведение текущего контроля успеваемости:

- лекции (занятия лекционного типа);
- семинары, практические занятия (занятия семинарского типа);
- групповые консультации;
- индивидуальные консультации и иные учебные занятия, предусматривающие индивидуальную работу преподавателя с обучающимся;
- самостоятельная работа обучающихся;
- занятия иных видов.

На учебных занятиях обучающиеся выполняют запланированные настоящей программой отдельные виды учебных работ. Учебное задание (работа) считается выполненным, если оно оценено преподавателем положительно.

В рамках самостоятельной работы обучающиеся осуществляют теоретическое изучение дисциплины с учётом лекционного материала, готовятся к практическим занятиям, выполняют домашнее задания, осуществляют подготовку к промежуточной аттестации.

Содержание дисциплины, виды, темы учебных занятий и форм контрольных мероприятий дисциплины представлены в разделе 5 настоящей программы и фонде оценочных средств по дисциплине.

**Текущая аттестация по дисциплине (модулю).** Оценивание обучающегося на занятиях осуществляется в соответствии с положением о текущей аттестации обучающихся в университете.

По итогам текущей аттестации, ведущий преподаватель (лектор) осуществляет допуск обучающегося к промежуточной аттестации.

**Допуск к промежуточной аттестации по дисциплине (модулю).** Обучающийся допускается к промежуточной аттестации по дисциплине в случае выполнения им всех

заданий и мероприятий, предусмотренных настоящей программой дисциплины в полном объеме. Преподаватель имеет право изменять количество и содержание заданий, выдаваемых обучающимся (обучающемуся), исходя из контингента (уровня подготовленности).

Допуск обучающегося к промежуточной аттестации по дисциплине осуществляет преподаватель, ведущий семинарские (практические) занятия.

Обучающийся, имеющий учебные (академические) задолженности (пропуски учебных занятий, не выполнивший успешно задания(е)) обязан отработать их в полном объеме.

**Отработка учебных (академических) задолженностей по дисциплине (модулю).**

В случае наличия учебной (академической) задолженности по дисциплине, обучающийся отработывает пропущенные занятия и выполняет запланированные и выданные преподавателем задания. Отработка проводится в период семестрового обучения или в период сессии согласно графику (расписанию) консультаций преподавателя.

Обучающийся, пропустивший *лекционное занятие*, обязан предоставить преподавателю реферативный конспект соответствующего раздела учебной и монографической литературы (основной и дополнительной) по рассматриваемым вопросам в соответствии с настоящей программой.

Обучающийся, пропустивший *практическое занятие*, отработывает его в форме реферативного конспекта соответствующего раздела учебной и монографической литературы (основной и дополнительной) по рассматриваемым на *практическом* занятии вопросам в соответствии с настоящей программой или в форме, предложенной преподавателем. Кроме того, выполняет все учебные задания. Учебное задание считается выполненным, если оно оценено преподавателем положительно.

Преподаватель имеет право снизить балльную (в том числе рейтинговую) оценку обучающемуся за невыполненное в срок задание (по неуважительной причине).

**Промежуточная аттестация по дисциплине (модулю).** Формой промежуточной аттестации по дисциплине определен зачет с оценкой.

Оценка знаний обучающегося оценивается по критериям, представленным в фонде оценочных средств по дисциплине.

**6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)**

Таблица 5. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

№ раздела	Наименование раздела	Содержание средств контроля (вопросы самоконтроля)	Учебно-методическое обеспечение*	Трудоемкость
<i>гр.1</i>	<i>гр.2</i>	<i>гр.3</i>	<i>гр.4</i>	<i>гр.5</i>
1.	Тема 1. Концепция риска и методы его оценки	Подготовка к практическим занятиям по вопросам, предложенным преподавателем Подготовка реферата Подготовка к вопросам промежуточной аттестации,	О: [1-3] Д: [1-3]	19

		связанных с темой		
2.	Тема 2. Методы идентификации, измерения и картографирования рисков	Подготовка к практическим занятиям по вопросам, предложенным преподавателем Подготовка реферата Подготовка к вопросам промежуточной аттестации, связанных с темой	О: [1-3] Д: [1-3]	19
3.	Тема 3. Риск-менеджмент - система управления риском	Подготовка к практическим занятиям по вопросам, предложенным преподавателем Подготовка реферата Подготовка к вопросам промежуточной аттестации, связанных с темой	О: [1-3] Д: [1-3]	19
4.	Тема 4. Стратегия риск-менеджмента	Подготовка к практическим занятиям по вопросам, предложенным преподавателем Подготовка реферата Подготовка к вопросам промежуточной аттестации, связанных с темой	О: [1-3] Д: [1-3]	19
5.	Тема 5. Риски внешнеэкономической деятельности	Подготовка к практическим занятиям по вопросам, предложенным преподавателем Подготовка реферата Подготовка к вопросам промежуточной аттестации, связанных с темой	О: [1-3] Д: [1-3]	19
6.	Тема 6. Страхование в управлении рисками	Подготовка к практическим занятиям по	О: [1-3] Д: [1-3]	19

		вопросам, предложенным преподавателем Подготовка реферата Подготовка к вопросам промежуточной аттестации, связанных с темой		
7.	Тема 7. Методы управления финансовыми рисками	Подготовка к практическим занятиям по вопросам, предложенным преподавателем Подготовка реферата Подготовка к вопросам промежуточной аттестации, связанных с темой	О: [1-3] Д: [1-3]	18

Примечание: О: – основная литература, Д: – дополнительная литература; в скобках – порядковый номер по списку

Для более углубленного изучения темы задания для самостоятельной работы рекомендуется выполнять параллельно с изучением данной темы. При выполнении заданий по возможности используйте наглядное представление материала. Система накопления результатов выполнения заданий позволит вам создать копилку знаний, умений и навыков, которую можно использовать как при прохождении практики, так и в будущей профессиональной деятельности.

### **7. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации**

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю), входящий в состав соответственно рабочей программы дисциплины (модуля), включает в себя:

- перечень компетенций, с указанием этапов их формирования в процессе освоения дисциплины (п. 3);
- описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, а также описание шкал оценивания, включающих три уровня освоения компетенций (минимальный, базовый, высокий). Примерные критерии оценивания различных форм промежуточной аттестации приведены в таблицах 6.1 и 6.2. Такие критерии должны быть разработаны по всем формам оценочных средств, используемых для формирования компетенций данной дисциплины;
- типовые контрольные задания и другие материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы;
- методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

**Таблица 6.1**  
**Критерии оценки промежуточной аттестации в форме зачета**

Оценка	Характеристика требований к результатам аттестации в форме зачета
«Зачтено»	Теоретическое содержание курса освоено полностью без пробелов или в целом, или большей частью, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы или в основном сформированы, все или большинство предусмотренных рабочей программой учебных заданий выполнены, отдельные из выполненных заданий содержат ошибки
«Не зачтено»	Теоретическое содержание курса освоено частично, необходимые навыки работы не сформированы или сформированы отдельные из них, большинство предусмотренных рабочей учебной программой заданий не выполнено либо выполнено с грубыми ошибками, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к минимуму.

**Таблица 6.2**

**Критерии оценки промежуточной аттестации в форме экзамена**

Оценка	Характеристика требований к результатам аттестации в форме экзамена
«Отлично»	Теоретическое содержание курса освоено полностью без пробелов, системно и глубоко, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы, все предусмотренные рабочей учебной программой учебные задания выполнены безупречно, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к максимуму.
«Хорошо»	Теоретическое содержание курса освоено в целом без пробелов, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом в основном сформированы, предусмотренные рабочей учебной программой учебные задания выполнены с отдельными неточностями, качество выполнения большинства заданий оценено числом баллов, близким к максимуму.
«Удовлетворительно»	Теоретическое содержание курса освоено большей частью, но пробелы не носят существенного характера, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом в основном сформированы, большинство предусмотренных рабочей учебной программой учебных заданий выполнены, отдельные из выполненных заданий содержат ошибки.
«Неудовлетворительно»	Теоретическое содержание курса освоено частично, необходимые навыки работы не сформированы или сформированы отдельные из них, большинство предусмотренных рабочей учебной программой учебных заданий не выполнено либо выполнено с грубыми ошибками, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к минимуму.

Все формы оценочных средств, приводимые в рабочей программе, должны соответствовать содержанию учебной дисциплины, и определять степень сформированности компетенций по каждому результату обучения.

**Таблица 6.3.**

**Степень формирования компетенций формами оценочных средств по темам дисциплины**

№ п/п	Тема	Форма оценочного средства	Степень формирования компетенции
-------	------	---------------------------	----------------------------------

1.	Тема 1. Концепция риска и методы его оценки	Реферат Тесты Вопросы для устного опроса на семинарских занятиях Контрольные вопросы Вопросы к промежуточной аттестации	<i>ПК-1; ПК-2, (60%)</i>
2.	Тема 2. Методы идентификации, измерения и картографирования рисков	Реферат Тесты Вопросы для устного опроса на семинарских занятиях Контрольные вопросы Вопросы к промежуточной аттестации	<i>ПК-1; ПК-2, (60%)</i>
3	Тема 3. Риск-менеджмент - система управления риском	Реферат Тесты Вопросы для устного опроса на семинарских занятиях Контрольные вопросы Вопросы к промежуточной аттестации	<i>ПК-1; ПК-2, (60%)</i>
4	Тема 4. Стратегия риск-менеджмента	Реферат Тесты Вопросы для устного опроса на семинарских занятиях Контрольные вопросы Вопросы к промежуточной аттестации	<i>ПК-1; ПК-2, (60%)</i>
5	Тема 5. Риски внешнеэкономической деятельности	Реферат Тесты Вопросы для устного опроса на семинарских занятиях Контрольные вопросы Вопросы к промежуточной аттестации	<i>ПК-1; ПК-2, (60%)</i>
6	Тема 6. Страхование в управлении рисками	Реферат Тесты Вопросы для устного опроса на семинарских занятиях Контрольные вопросы Вопросы к промежуточной аттестации	<i>ПК-1; ПК-2, (60%)</i>
7	Тема 7. Методы управления финансовыми рисками	Реферат Тесты Вопросы для устного опроса на семинарских	<i>ПК-1; ПК-2, (60%)</i>

		занятиях Контрольные вопросы Вопросы к промежуточной аттестации	
--	--	--	--

**Типовые контрольные задания и другие материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы**

**Вопросы текущего контроля успеваемости на семинарах (практических занятиях)**

- 1 Построение профилей рисков;
- 2 Оценка VaR в задачах оценки рисков;
- 3 Оценка инвестиционных, ценовых, процентных рисков методом Монте-Карло;
- 4 Оценки риска при формировании портфелей;
- 5 Оценки риска через CAPM, SML, ATR

**Типовые темы рефератов**

1. Стратегические риски иуправлении финансовым институтом.
2. Стратегические риски в управлении корпорациями в реальном секторе экономики.
3. Учет инновационных рисков в деятельности крупных компаний.
4. Учет инновационных рисков в деятельности малых компаний.
5. Учет инновационных рисков при коммерциализации научных результатов.

**Типовые тесты / задания**

1 В какое время риск становится объектом внимания и изучения ученых и предпринимателей:

- а) Новое время
- б) Средние века
- в) XX век

2 Кто сумел оценить численность населения Лондона с помощью техники статистического заключения:

- а) Э. Ллойд
- б) Д. Бернулли
- в) Д. Граунт

3 Как называется документ – свод данных корабельного дела, предоставляемых сетью европейских корреспондентов:

- а) Свод Гальтона
- б) Журнал Миля
- в) Регистр Ллойда

4 Английский математик и астроном, который показал, как рассчитать стоимость



страхового возмещения на основе данных об ожидаемой продолжительности жизни и возрасте страхователя:

- а) Ф. Гальтон
- б) Дж.М. Кейнс
- в) Э. Галлей

5 Математик, открывший "Закон Больших Чисел":

- а) Д. Бернулли
- б) А. де Муавр
- в) Я. Бернулли

#### **Типовые контрольные вопросы**

- 1 Сущность риска, основные элементы, причины возникновения.
- 2 Объекты и субъекты риска.
- 3 Факторы риска.
- 4 Виды ущерба от риска.
- 5 Характеристика системы управления рисками. Суть, причины, процедуры и форма управления рисками. Задачи, решаемые при управлении рисками, правила риск-менеджмента.

#### **Типовые вопросы к промежуточной аттестации**

1. Сущность и виды рисков. Классификация корпоративных рисков.
  2. Содержание риск-менеджмента в компании.
  3. Идентификация рисков компании. Построение карты рисков в координатах «вероятность-размер ущерба».
  4. Стандарты риск-менеджмента. Подходы к регулированию рисков в финансовых и нефинансовых организациях.
  5. Концепция COSO. Основные компоненты процесса управления рисками.
- Все оценочные средства к дисциплине приведены в ФОС, который является приложением к настоящей РПД.

### **8. Учебно-методическое и информационное обеспечение учебной дисциплины/модуля**

#### **8.1. Основная литература**

1. Фомичев А.Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учебник для бакалавров / А.Н. Фомичев. — Электрон.текстовые данные. — М. : Дашков и К, 2016. — 372 с. — 978-5-394-02676-8. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/60617.html>
2. Страховое дело и инструменты страховой защиты в риск-менеджменте [Электронный ресурс] : учебное пособие для магистров / А.Г. Бадалова [и др.]. — Электрон.текстовые данные. — М. : Дашков и К, 2016. — 135 с. — 978-5-394-02706-2. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/60623.html>

3. Буянский С.Г. Корпоративное управление, комплаенс и риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учебное пособие для магистрантов / С.Г. Буянский, Ю.В. Трунцевский. — Электрон.текстовые данные. — М. :Русайнс, 2016. — 342 с. — 978-5-4365-0813-9. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/61620.html>

## **8.2. Дополнительная литература**

1. Иванов А.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учебное пособие / А.А. Иванов, С.Я. Олейников, С.А. Бочаров. — Электрон. текстовые данные. — М. : Евразийский открытый институт, 2011. — 304 с. — 978-5-374-00013-6. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10817.html>
2. Селюков В.К. Риск-менеджмент организации [Электронный ресурс] : учебное пособие / В.К. Селюков. — Электрон.текстовые данные. — М. : Московский государственный технический университет имени Н.Э. Баумана, 2008. — 187 с. — 978-5-7038-3205-9. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/31560.html>
3. Шевцова Ю.В. Байесовы технологии. Их реализация в программной среде Hugin и применение в операционном риск-менеджменте [Электронный ресурс] : учебное пособие / Ю.В. Шевцова. — Электрон.текстовые данные. — Новосибирск: Сибирский государственный университет телекоммуникаций и информатики, 2010. — 77 с. — 2227-8397. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/54760.html>

## **8.3 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля)**

1. e-Library.ru [Электронный ресурс]: Научная электронная библиотека. – URL: <http://elibrary.ru/> (дата обращения 11.05.2018).
2. Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» [Электронный ресурс]. – URL: <http://cyberleninka.ru/> (дата обращения 11.05.2018).
3. Электронно-библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» [Электронный ресурс]. – URL: <http://biblioclub.ru/index.php>(дата обращения 11.07.2018). – Доступ к системе согласно правилам ЭБС и договором университета с ЭБС.
4. Электронно-библиотечная система IPRbooks[Электронный ресурс]. – URL: <http://www.iprbookshop.ru/> (дата обращения 11.07.2018). – Доступ к системе согласно правилам ЭБС и договором университета с ЭБС.

- внимательно прочитайте материал лекций, относящихся к данному семинарскому занятию, ознакомьтесь с учебным материалом по учебнику и учебным пособиям,
- выпишите основные термины,
- ответьте на контрольные вопросы по семинарским занятиям, готовьтесь дать развернутый ответ на каждый из вопросов,
- определите, какие учебные элементы остались для вас неясными и постарайтесь получить на них ответ заранее (до семинарского занятия) во время текущих консультаций преподавателя,
- выполните домашнее задание.

Учтите, что:

- готовиться можно индивидуально, парами или в составе малой группы (последние являются эффективными формами работы);
- рабочая программа дисциплины в части целей, перечню знаний, умений, терминов и учебных вопросов может быть использована вами в качестве ориентира в организации обучения.

*Подготовка к промежуточной аттестации.* К промежуточной аттестации необходимо готовиться целенаправленно, регулярно, систематически и с первых дней

#### **8.4. Перечень программного обеспечения**

Для подготовки презентаций и их демонстрации необходима программа Impress из свободного пакета офисных приложений OpenOffice (или иной аналог с коммерческой или свободной лицензией).

#### **Перечень информационных справочных систем**

1. Словари и энциклопедии на Академике [Электронный ресурс] // Академик. – URL: <http://dic.academic.ru>.
2. Электронно-библиотечная система IPRbooks [Электронный ресурс]. – URL: <http://www.iprbookshop.ru>. – Доступ к системе согласно правилам ЭБС и договором университета с ЭБС.

#### **9. Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины/модуля**

Материально-техническое обеспечение учебного процесса по дисциплине определено нормативными требованиями, регламентируемыми приказом Министерства образования и науки РФ № 986 от 4 октября 2010 г. «Об утверждении федеральных требований к образовательным учреждениям в части минимальной оснащенности учебного процесса и оборудования учебных помещений», Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки.

Для проведения всех видов учебных занятий по дисциплине и обеспечения интерактивных методов обучения, необходимы столы, стулья (на группу по количеству посадочных мест с возможностью расстановки для круглых столов, дискуссий, прочее); доска интерактивная с рабочим местом (мультимедийный проектор с экраном и рабочим местом); желателен доступ в информационно-коммуникационную сеть «Интернет».

В соответствии с требованиями ФГОС ВО при реализации настоящей дисциплины ОПОП ВО необходимо также учитывать образовательные потребности обучающихся с ограниченными возможностями здоровья, обеспечивать условия для их эффективной реализации, а также возможности беспрепятственного доступа обучающихся с ограниченными возможностями здоровья к объектам инфраструктуры образовательного учреждения.

Программу составила: к.э.н, доцент кафедры менеджмент Плиева Н.М.  
(Ф.И.О., должность, подпись)

Программа одобрена на заседании кафедры «Менеджмент»

Протокол № 8 от « 17 » 06 2022года

Зав. кафедрой «Менеджмент» / \_\_\_\_\_ Угурчиев О.Б.

Программа одобрена Учебно-методическим советом факультета экономики и управления

протокол № 10 от « 22 » 06 2022 года

Председатель

Учебно-методического совета факультета экономики и управления \_\_\_\_\_ / Поланкоева Ф.Я.

Программа рассмотрена на заседании Учебно-методического совета университета

протокол № 10 от « 29 » 06 2022г.

Председатель Учебно-методического совета университета \_\_\_\_\_ /Хашагульгов Ш.Б.