

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации**  
**Пермский институт (филиал)**  
**Федерального государственного бюджетного образовательного учреждения**  
**высшего образования**  
**«Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова»**

---

Одобрено  
на заседании Учебно-методического совета  
Пермского института (филиала)  
протокол № 9 от «20» июня 2018 г.  
Председатель совета  В.Н. Яковлев



**Факультет Учетно-финансовый**  
**Кафедра Экономического анализа и статистики**

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**  
**для набора 2018года**

**Б1.В.ДВ.03.02    Управление рисками в деятельности компании**

Направление подготовки                      38.04.02

**МЕНЕДЖМЕНТ**

Магистерская программа

*Магистр делового администрирования*

Уровень высшего образования    **Магистратура**

Программа подготовки    **Академическая магистратура**

Рецензенты:

1. Шушарин В. Ф., к.э.н./доцент кафедры менеджмента и гуманитарных дисциплин, ПИ (ф) РЭУ им. Г. В. Плеханова
2. Лебедева Л. Н., доцент кафедры государственного и муниципального управления, ПФ ГУ-ВШЭ

Аннотация рабочей программы дисциплины

Целью изучения дисциплины «Управление рисками в деятельности компании» является углубление знаний в области управления рисками предпринимательской и финансовой деятельности при принятии и реализации управленческих решений в коммерческой организации.

Задачей дисциплины является: выработка у обучаемых необходимых знаний, умений и навыков, позволяющих им выполнять основные виды профессиональной деятельности в сфере оценки и управления рисками коммерческих организаций с учетом сложившейся конъюнктуры рынка.

Рабочая программа составлена на основании Федерального государственного образовательного стандарта

38.04.01 «Экономика»

Составитель:



Тетенова И.А. ст. преп. кафедры экономического анализа и статистики

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры экономического анализа и статистики протокол № 8 от «24» мая 2018 г.

Заведующий кафедрой



/ Лунева М.Н.)

(подпись)

Согласовано



Ошинский П.В., зам.директора ООО СК «Прогресс»

МП

(подпись)

(ФИО представителя бизнес-сообщества или государственных органов управления, должность и место работы)

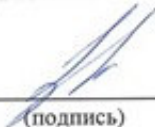
Зам. директора

Ошинский П.В.



Дополнения и изменения, внесенные в рабочую программу, утверждены на заседании кафедры экономического анализа и статистики протокол № 9 от «25» апреля 2019 г.

Заведующий кафедрой



(подпись)

М.Н. Лунева

Одобрено УМС Пермского института (филиала) РЭУ им. Г.В. Плеханова протокол № 9 от «26» июня 2019 г.

Председатель



(подпись)

В.Н. Яковлев

# Содержание

<b>I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ .....</b>	<b>5</b>
Цель дисциплины.....	5
Учебные задачи дисциплины .....	5
Место дисциплины в структуре ОПОП ВО (основной профессиональной образовательной программы высшего образования).....	5
Требования к результатам освоения содержания дисциплины .....	6
Формы контроля.....	6
<b>II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....</b>	<b>8</b>
<b>III. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ .....</b>	<b>10</b>
<b>IV. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ, ИНФОРМАЦИОННОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....</b>	<b>10</b>
4.1. Рекомендуемая литература.....	10
4.2. Перечень информационно-справочных систем .....	11
4.3. Перечень электронно-образовательных ресурсов.....	11
4.4. Перечень профессиональных баз данных.....	11
4.5. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины (модуля).....	11
4.6. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения ...	<b>Ошибка! Закладка не определена.</b>
Материально-техническое обеспечение дисциплины (разделов).....	<b>Ошибка! Закладка не определена.</b>
<b>V. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ .....</b>	<b>15</b>
<b>VI. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ .....</b>	<b>16</b>
6.1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы (см. таблицу раздела II).....	16
6.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (см. таблицу раздела II и раздел VIII).....	16
6.3.Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы .....	16
<b>VII. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ).....</b>	<b>20</b>
<b>VIII. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И (ИЛИ) ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ .....</b>	<b>21</b>
Приложение 1.....	26
Приложение 2.....	27

## I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ

### *Цель дисциплины*

Целью изучения дисциплины «Управление рисками в деятельности компании» является углубление знаний в области управления рисками предпринимательской и финансовой деятельности при принятии и реализации управленческих решений в коммерческой организации.

### *Учебные задачи дисциплины*

Задачей дисциплины является: выработка у обучаемых необходимых знаний, умений и навыков, позволяющих им выполнять основные виды профессиональной деятельности в сфере оценки и управления рисками коммерческих организаций с учетом сложившейся конъюнктуры рынка.

### *Место дисциплины в структуре ОПОП ВО (основной профессиональной образовательной программы высшего образования)*

Дисциплина «Управление рисками в деятельности компании», относится к вариативной части учебного плана, дисциплина по выбору.

### **Объем дисциплины и виды учебной работы**

Показатель объема дисциплины	Всего часов	
	Очная ф.о.	Очно-заочная ф.о.
Объем дисциплины в зачетных единицах	4 ЗЕТ	
Объем дисциплины в часах	144	
<b>Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) (всего)</b>	<b>26</b>	<b>26</b>
Объем аудиторной работы (всего)	24	24
в том числе:		
• лекции	8	8
• лабораторные занятия	-	-
• практические занятия	16	16
Объем электронного обучения	-	-
в том числе:		
• лекции	-	-
• практические занятия	-	-
Индивидуальные консультации (ИК)		
Контактная работа по пром. аттестации (Катт)	2	2
Консультации перед экзаменом (КЭ)		
Контактная работа по пром. аттестации (Каттэк)		
<b>Самостоятельная работа (всего)</b>	<b>118</b>	<b>118</b>
В том числе :		
Самостоятельная работа в семестре (СР)	118	118
Самостоятельная работа пер.экз.сессии (Контроль)		

Дисциплина основывается на знании следующих дисциплин: «Финансовая диагностика и моделирование перспектив развития», «Международные экономические отношения»

Для успешного освоения дисциплины «Управление рисками в деятельности компании», магистрант должен:

1. **Знать** сущность экономических процессов как на макро- так и на микроуровне, экономические категории и показатели (ОК-3, ОПК – 2,4 ПК-1,3)  
знать основы математического анализа и области его применения в анализе экономических процессов. (ОК-3 ОПК – 1,2,3 ПК-2,4,7)
2. **Уметь** находить взаимосвязи экономических процессов, экономических категорий и показателей (ОК-3 ОПК – 1, 2 ПК-2,4,5)
3. **Владеть** навыками математического анализа (ОК-3 ОПК – 1,2,3 ПК-7)

Изучение дисциплины «Управление рисками в деятельности компании» необходимо для дальнейшего изучения таких дисциплин, как: «Корпоративные финансы», «Управление инновациями и инвестициями», «Управление инновационными проектами».

### ***Требования к результатам освоения содержания дисциплины***

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

#### **Вид деятельности: аналитическая**

**ПК-4** - способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения.

В результате освоения компетенции **ПК-4** магистрант должен:

1. **Знать:** основные официальные методические документы, регламентирующие инвестиционную и оценочную деятельность и проведение оценочных работ в Российской Федерации; особенности проведения оценки стоимости бизнеса для конкретных целей: инвестирования капитала, налогообложения, реструктуризации и антикризисного управления;
2. **Уметь:** сформулировать цель оценки и приоритеты использования методов для конкретных целей оценки и особенностей оцениваемого бизнеса;
3. **Владеть:** количественными и качественными методами для проведения оценки бизнеса, готовить аналитические материалы по результатам их применения.

**ПК-5** - владением методами экономического и стратегического анализа поведения экономических агентов и рынков в глобальной среде.

В результате освоения компетенции **ПК-5** магистрант должен:

1. **Знать:** основные методы оценки бизнеса: доходный, сравнительных продаж, накопленных активов; основные виды рисков, связанных с принятием решений об инвестициях с целью повышения стоимости бизнеса;
2. **Уметь:** использовать методы технического и фундаментального анализа с целью оценки текущей и справедливой рыночной стоимости бизнеса; уметь принимать решения, связанные с управлением стоимостью капитала и стоимостью бизнеса;

**Владеть:** навыками оценки бизнеса, инновационно-инвестиционных программ и управления стоимостью бизнеса.

#### ***Формы контроля***

*Текущий и рубежный контроль* осуществляется лектором и преподавателем, ведущим практические занятия, в соответствии с тематическим планом.

#### ***Промежуточная аттестация в 2 семестре – зачет с оценкой***

Результаты текущего контроля и промежуточной аттестации формируют рейтинговую оценку работы магистранта. Распределение баллов при формировании рейтинговой оценки работы магистранта осуществляется в соответствии с «Положением о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний магистрантов в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего образования «Российский экономический

университет имени Г.В. Плеханова». Распределение баллов по отдельным видам работ в процессе освоения дисциплины «Управление рисками в деятельности компании» осуществляется в соответствии с разделом VIII.

## II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

и описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования в процессе освоения образовательной программы

№ п/п	Наименование раздела дисциплины (темы)	Содержание	Формируемые компетенции	Результаты освоения (знать, уметь, владеть, понимать)	Образовательные технологии
<b>Семестр 3. Раздел 1. Теоретические особенности рисков, риски предпринимательской деятельности</b>					
1.	Тема 1. Процесс управления риском предпринимательской деятельности	Понятие Рисковой ситуации. Объективные причины риска. Понятие предпринимательского и финансового риска. Субъективная природа предпринимательского риска. Модификации рисков явлений. Классификация риска, существующие подходы. Информационно-методическое и правовое обеспечение. Виды предпринимательских рисков для предприятий различных отраслей. Предпринимательские риски торговых предприятий. Задачи управления риском. Основные принципы управления риском. Идентификация внутренних и внешних факторов риска. Ранжирование рисков. Этапы управления. Методы управления риском. Лимитирование. Хеджирование. Механизм разработки мер по снижению риска на предприятии. Построение модели управления риском.	ПК-4, ПК-5	<b>Знать:</b> сущность риска, его классификацию и основные черты. задачи управления риском и основные принципы управления. <b>Уметь:</b> выделять необходимые источники информации, собирать информацию. <b>Владеть:</b> навыками выделения источников и сбора информации	Лекции, практические занятия, самостоятельная работа с литературой, подготовка докладов, написание эссе
2.	Тема 2. Методы оценки предпринимательских рисков	Анализ исходных данных для. Определение рисков при постановке миссии и целей компании. Критерии оптимальности. Теория игр. Оптимальность по Парето. Статистические методы принятия решений в условиях неопределенности. Аналитические методы. Метод чувствительности критических отношений. Коэффициент VaR. Волатильность. Коэффициент вариации. Бета-коэффициент. Метод анализа сценариев: сравнительная оценка вариантов решений. Имитационное моделирование. Оценка целесообразности затрат. Методы расчета интегральных показателей риска. Модели прогнозирования риска банкротства. Метод экспертных оценок. Метод «мозговой атаки». Синектический метод. Метод Делфи. Метод ПАТТЕРН. Метод аналогий.	ПК-4, ПК-5	<b>Знать:</b> методы оценки рисков; <b>Уметь:</b> применять методы при анализе и оценке рисков <b>Владеть:</b> навыками оценки и управления рисками	Лекции, семинарские занятия, письменное домашнее задание, самостоятельная работа с литературой, подготовка докладов, написание эссе



		Качественные модели прогнозирования риска банкротства.			
<b>Раздел 2. Методы управления предпринимательскими рисками на предприятии</b>					
3.	Тема 3. Способы снижения предпринимательских рисков	Уклонение от риска. Методы оптимизации риска. Диверсификация риска. Методы локализации риска. Диссипация риска. Информатизация процесса управления. Анализ и прогнозирование денежных потоков. Учет рисков с использованием ставки дисконтирования. Коммерческие, предпринимательские и финансовые риски как объект страховой защиты. Самострахование. Страхование от простоев предприятия. Страхование прибыли, доходов, арендных платежей. Страхование финансовых рисков, связанных с ключевой фигурой бизнеса. Страхование риска непредвиденных судебных расходов. Страхование риска банкротства. Страхование кредитных рисков. Страхование банковских рисков. Страхование инвестиций.	ПК-4, ПК-5	<b>Знать:</b> способы снижения предпринимательских рисков. <b>Уметь:</b> применять способы снижения рисков на практике. <b>Владеть:</b> навыками поиска и применения методов снижения рисков на коммерческом предприятии	Лекции, практические занятия, письменное домашнее задание, подготовка докладов, написание эссе; расчетно-аналитическое задание; анализ деловой ситуации
4.	Тема 4. Финансовые риски: оценка и управление ими на коммерческом предприятии	Финансовая среда предпринимательства. Государственное регулирование и формирование финансовой среды предпринимательства. Виды финансовых рисков. Управление финансовыми рисками. Риск инвестиционной деятельности. Методы оценки риска инвестиций.	ПК-4, ПК-5	<b>Знать:</b> особенности формирования и использования финансовых ресурсов предприятия <b>Уметь:</b> выделять финансовые риски предприятия <b>Владеть:</b> навыками расчета финансовых показателей предприятия	Лекции, практические занятия, самостоятельная работа с литературой, расчетно-аналитическое задание, консультации преподавателей, подготовка докладов, написание эссе

### **III. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ**

В процессе освоения дисциплины «Управление рисками в деятельности компании» используются следующие образовательные технологии:

1. Стандартные методы обучения:
  - Лекции;
  - Практические занятия, на которых обсуждаются основные вопросы развития деятельности в условиях риска, рассмотренные в лекциях, учебной литературе и раздаточном материале;
  - Письменные домашние работы;
  - Расчетно-аналитические задания;
  - Самостоятельная работа магистров, в которую включается написание эссе, подготовка к докладам;
  - Консультации преподавателей.
2. Методы обучения с применением интерактивных форм образовательных технологий:
  - Анализ деловых ситуаций (кейс-стади)
  - Семинар-конференция
  - Расчетно-аналитические задания с применением мозгового штурма

### **IV. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ, ИНФОРМАЦИОННОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

#### **4.1. Рекомендуемая литература**

##### **4.1. Основная литература:**

1. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия / Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С., -3-е изд. - М.: Дашков и К, 2017. - 418 с.: ISBN 978-5-394-02256-2 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/415224>
2. Управление рисками предприятия : учебное пособие / В.Н. Уродовских. — М. : Вузовский учебник, ИНФРА-М, 2017. — 168 с. - Режим доступа: <http://znanium.com>

##### **Нормативно-правовые документы:**

1. Конституция РФ, принята всенародным голосованием 12.12.1993 (с учетом поправок, внесенных Законами РФ о поправках к Конституции РФ от 30.12.2008 N 6-ФКЗ, от 30.12.2008 N 7-ФКЗ).
2. Гражданский кодекс Российской Федерации часть первая от 30.11.1994 N 51-ФЗ (в актуальной ред.).
3. Налоговый кодекс Российской Федерации, часть 1 (№146-ФЗ от 31.07.1998 г. в актуальной ред.).
4. Налоговый кодекс Российской Федерации, часть 2 (N 117-ФЗ от 05.08.2000 в актуальной ред.).
5. Федеральный закон «Об акционерных обществах», №208-ФЗ от 26.12.1995 г. (в актуальной ред.).
6. Федеральный закон от 02.12.1990г. № 395-1 «О банках и банковской деятельности» (в актуальной ред.).
7. Федеральный закон от 10.07.2002г за № 86 - ФЗ «О центральном банке РФ (Банке России)» (в актуальной ред.).
8. Федеральный закон от 26.10.2002 N 127-ФЗ "О несостоятельности (банкротстве)» (в актуальной ред.).

#### **Дополнительная литература:**

1. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: Пособие / Шапкин А.С., Шапкин В.А., - 9-е изд. - М.: Дашков и К, 2018. - 544 с.: 60x84 1/16 ISBN 978-5-394-02150-3 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/339372>
2. Механизм комплексной оценки и управления рисками предприятий промышленности: Монография / Дзгоева М.Р., Цховребов А.Р., Комаева Л.Э. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2017. - 120 с. Режим доступа: <http://znanium.com/>
3. Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — М. : ИНФРА-М, 2017. — 153 с. - Режим доступа: <http://znanium.com/>
4. Управление рисками на предприятии : учебное пособие / С.М. Васин, В.С. Шутов. — Москва : КноРус, 2018. — 299 с. ЭБС «BOOK.ru»
5. Уколов, А.И. Управление корпоративными рисками: инструменты хеджирования : учебник / А.И. Уколов, Т.Н. Гупалова. -2-е изд., стер. - Москва : Директ-Медиа, 2017. - 554 с. : ил., схем., табл. - Библиогр.: с. 547. - ISBN 978-5-4475-9318-6 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/>.
6. Уколов, А.И. Оценка рисков : учебник / А.И. Уколов. -2-е изд. стер. - Москва : Директ-Медиа, 2018. - 627 с. : ил., схем., табл. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-4475-2589-7 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/>

#### **4.2. Перечень информационно-справочных систем**

Справочная и поисковая система Консультант + - <http://www.consultant.ru/>

Справочная и поисковая система Гарант - <https://www.garant.ru/>

#### **4.3. Перечень электронно-образовательных ресурсов**

- <http://moodle.rea.perm.ru/>

#### **4.4. Перечень профессиональных баз данных**

- База данных Научной электронной библиотеки - eLIBRARY.ru  
<https://elibrary.ru/defaultx.asp>
- База данных ScienceDirect содержит более 1500 журналов издательства Elsevier, среди них издания по экономике и эконометрике, бизнесу и финансам, социальным наукам и психологии, математике и информатике. Коллекция журналов Economics, Econometrics and Finance -  
<https://www.sciencedirect.com/#open-access>

#### **4.5. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины (модуля)**

- Госкомстат РФ - [www.gks.ru](http://www.gks.ru)
- ЦБ РФ - [www.cbr.ru](http://www.cbr.ru)
- Центр экономической конъюнктуры при правительстве РФ - [www.sea.gov.ru](http://www.sea.gov.ru)
- Росбизнесконсалтинг - [www.rbk.ru](http://www.rbk.ru).
- Агентство АК&М.- [www.akm.ru](http://www.akm.ru)
- Центральный экономико-математический институт - [www.semi.rssi.ru](http://www.semi.rssi.ru)
- Центр микроэкономического анализа и прогнозирования - [www.forecast.ru](http://www.forecast.ru)
- Финансовое казначейство РФ - [www.budget.ru](http://www.budget.ru)
- Министерство экономического развития РФ - [www.economy.gov.ru](http://www.economy.gov.ru)
- Министерство сельского хозяйства РФ - [www.mcsx.ru](http://www.mcsx.ru)
- Министерство финансов РФ - [www.minfin.ru](http://www.minfin.ru)

**4.6. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения**

**Программное обеспечение:**

Операционная система Microsoft Windows 7, Пакет прикладных программ Microsoft Office: 2010, Visual Studio 2017-2019 community, Acrobat Reader DC, 7-Zip, Notepad ++, Графический редактор GIMP, Inkscape, Электронный справочник 2GiS, Справочная Правовая система «Консультант плюс Эксперт», Электронный справочник "Система Гарант", Браузер: Google Chrome, Mozilla Firefox, MS Internet Explorer, Антивирусная программа Windows defender, Антивирусная программа 360 Total Security.

**4.7 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине**

**Раздел 1. Теоретические особенности рисков, риски предпринимательской деятельности**

**Тема 1. Процесс управления риском предпринимательской деятельности**

**Литература: О-1; О-2; Д-2; Д-3; Н-2.**

**Вопросы для самопроверки:**

1. Дайте определение предпринимательской деятельности.
2. Определите понятие предпринимательского и финансового риска
3. Назовите основные классификации предпринимательских рисков.
4. Назовите основные направления и правила риск-менеджмента.
5. Укажите приемы идентификации внутренних и внешних факторов риска.
6. Приведите доказательства необходимости государственного финансового регулирования экономики для снижения риска деятельности.

**Индивидуальные задания:**

1. Напишите эссе на тему: «Каковы риски предпринимательства в Российской Федерации?»
2. Найдите примеры ответа на вопрос: Каким образом с помощью государственных механизмов можно уменьшить риск деятельности в той или иной отрасли?
3. Напишите эссе на тему: «Роль риск-менеджмента в управлении предприятием»
4. Найдите примеры ответа на вопрос: Какие инструменты государственного финансового регулирования экономики имеются на макро- и микроуровнях?

**Тематика рефератов, докладов, эссе:**

1. Теории предпринимательских рисков
2. Информационно-методическое и правовое обеспечение управления рисками
3. Особенности современной финансовой политики снижения риска в развитых странах
4. Лимитирование, как метод управления риском
5. Хеджирование, как метод управления риском
6. Построение модели управления риском на предприятии

**Тема 2. Методы оценки предпринимательских рисков**

**Литература: О-1; О-2; Д-4; Д-7.**

**Вопросы для самопроверки:**

1. Перечислите основные методы количественной оценки
2. В чем сущность статистических методов оценки риска.
3. Дайте определение метода сценария, в каких случаях возможно его применение.
4. Укажите особенности применения методов качественной оценки рисков.
5. Дайте определение метода экспертных оценок.

#### **Индивидуальные задания:**

1. Напишите эссе на тему: «Многообразие и особенности применения методов количественной оценки рисков».
2. Подумайте над вопросом: Каков инструментарий для применения количественных методов оценки риска на предприятии.
3. Приведите примеры применения в предпринимательской деятельности следующих методов оценки риска, укажите инструментарий для реализации метода:
  - 1.1. Метод экспертных оценок
  - 1.2. Метод «мозговой атаки»
  - 1.3. Синектический метод
  - 1.4. Метод Делфи
  - 1.5. Метод ПАТТЕРН
  - 1.6. Метод аналогий

#### **Тематика рефератов, докладов, эссе:**

1. Этапы проведения статистических методов принятия решений в условиях неопределенности.
2. Метод чувствительности критических отношений.
3. Метод анализа сценариев: сравнительная оценка вариантов решений.
4. Имитационное моделирование.
5. Оценка целесообразности затрат.
6. Модели прогнозирования риска банкротства.

## **Раздел 2. Методы управления предпринимательскими рисками на предприятии**

### **Тема 3. Способы снижения предпринимательских рисков**

**Литература: О-1; О-3; Д-5; Д-7; Н-3,4.**

#### **Вопросы для самопроверки:**

1. Укажите способы снижения предпринимательских рисков.
2. Пути уклонения от риска
3. Методы локализации риска
4. Укажите объекты и субъекты страхования рисков.
5. Назовите органы управления вопросами страхования и их функции.
6. Охарактеризуйте местные органы страхования.

#### **Индивидуальные задания:**

1. Напишите эссе на тему: «Возможные варианты, типы финансовой политики, снижающие финансовый риск предприятия»
2. Составьте сравнительную характеристику на тему: Особенности страхования различных видов риска:
  - a. Страхование от простоев предприятия
  - b. Страхование прибыли, доходов, арендных платежей.
  - c. Страхование финансовых рисков, связанных с ключевой фигурой бизнеса.
  - d. Страхование риска непредвиденных судебных расходов.
  - e. Страхование риска банкротства.
  - f. Страхование кредитных рисков.

- g. Страхование банковских рисков.
- h. Страхование инвестиций.
- 3. Подготовьте доклады по теме: «Особенности страхования рисков в зарубежных странах (на примере США, Германии, Китая, Японии)»

#### **Тема 4. Финансовые риски и управление ими на предприятии**

**Литература: О-1; О-3; Д-4; Д-7, Н-3,4.**

##### **Вопросы для самопроверки:**

1. Дайте определение финансовой среды предпринимательства.
2. Укажите особенности формирования и использования финансовых ресурсов.
3. Назовите источники формирования собственных и привлеченных финансовых ресурсов и укажите риски привлечения финансовых ресурсов со стороны.
4. Какие методы оценки риска инвестиций Вам известны.

##### **Индивидуальные задания:**

1. Напишите эссе на тему: «Корпоративные финансовые риски: сущность, виды, величина, критерии степени риска. Способы снижения степени риска»
2. «Финансовая работа и планирование: содержание, задачи, роль в вопросах снижения финансового риска».

##### **Тематика рефератов, докладов, эссе:**

- 2.1 Роль финансовых рисков в сфере материального и нематериального производства.
- 2.2 Роль финансовых служб на предприятии.
- 2.3 Государственное регулирование и формирование финансовой среды предпринимательства.
- 2.4 Риск инвестиционной деятельности.

#### **4.8. Материально-техническое обеспечение дисциплины (разделов)**

Дисциплина обеспечена:

- учебной аудиторией для проведения занятий лекционного типа, оборудованной мультимедийными средствами обучения для демонстрации лекций-презентаций,
- учебной аудиторией для проведения занятий семинарского типа (семинары, практические занятия) для групповых и индивидуальных консультаций, промежуточной аттестации, оборудованной учебной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации студентам;
- помещениями для самостоятельной работы, оснащенной компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспеченной доступом в электронную информационно-образовательную среду Института.

## V. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

№ п/п	Наименование разделов и тем	Контактные часы								Самостоятельна я работа		Формы текущего/ рубежного контроля
		Аудиторные часы						Конт. часы по промеж у точной аттестаци (Катт)	Конт. часы по промежут очной аттестаци и в период экз.сессии (Каттэк)	формы	часы	
		Лекции	Практи- ческие занятия	Лабор а- торны е работ ы	Всего ауд.	в том числе интерактивные						
								формы	часы			
1	Процесс управления риском предпринимате льской деятельности	2	2		4					лит., подг. докл., напис ание эссе	18	Опрос
2	Методы оценки предпринимате льских рисков	2	4		6	А.д.с., р.а.з	4			лит., подг. докл., напис ание эссе	22	Проверка письменн ых заданий, тестирова ние
3	Способы снижения предпринимате льских рисков	2	4		6	А.д.с., р.а.з.	4			лит., р.а.з.	22	Опрос
4	Финансовые риски и управление ими на предприятии	2	4		6	А.д.с., р.а.з.	4			лит., п.з.	22	Опрос, проверка письменн ых заданий
Итого:		8	16		24		12	2			118	Зачет с оценкой
Всего по дисциплине 108 часов		8	16		24		12	2			118	

Сокращения, используемые в Тематическом плане изучения дисциплины:

№ п/п	Сокращение	Вид работы
1.	Лит	Работа с литературой
2.	П.з.	Выполнение письменной домашней работы
3.	Р.а.з.	Расчетно-аналитическое задание
4.	А.д.с.	Анализ деловых ситуаций на основе кейс-метода
5.	Подг. докл.	Подготовка докладов и рефератов
6.	Р.а.з.м.ш.	Расчетно-аналитическое задание, групповое с применением мозгового штурма

При реализации данной дисциплины по очно-заочной и заочной формам обучения к программе добавляются тематические планы изучения дисциплины по соответствующим формам как приложение к РПД.

## VI. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ <sup>1</sup>

Оценочные средства по дисциплине разработаны в соответствии с Положением о фонде оценочных средств в ФГБОУ ВО «РЭУ им. Г.В.Плеханова».

### 6.1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы (см. таблицу раздела II)

### 6.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания (см. таблицу раздела II и раздел VIII)

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

Пример контрольного задания для порогового этапа освоения компетенции ОК-1:

№ п/п	Содержание задания	Баллы	Отметка
<b>Правильный ответ на задание – 1 балл</b>			
1.	Что такое риски в рамках коммерческого предприятия?	0-компетенция не освоена; 1-недостаточно освоена; 2- освоена; 3-полностью освоена	неуд.
2.	Перечислите основные классификации рисков, характерных для коммерческого предприятия, назовите примеры рисков, существующие на сегодняшний день на предприятиях в Российской Федерации.		удов.
3.	Назовите отличие групп количественных и качественных методов оценки риска, дайте краткую характеристику групп методов, укажите преимущества и недостатки каждой группы методов.		хор. отл.

Пример контрольного задания для продвинутого и высокого этапов освоения компетенции ОК-1:

№ п/п	Содержание задания	Баллы	Отметка
<b>Правильный ответ на задание – 1 балл</b>			
1.	Докажите, что правильная финансовая политика является методом снижения рисков на коммерческом предприятии. О каких рисках идет речь? Ответ обосновать.	0-компетенция не освоена; 1-недостаточно освоена; 2- освоена; 3-полностью освоена	неуд.
2.	Предположим, что коэффициент вариации в 2015 году составлял - 32%, а в 2016 году – 38%. Какой год был более рискованным для предприятия? Укажите суть статистических методов оценки риска.		удов.
3.	Какие показатели финансового анализа отражают риск предпринимательской организации. Предположим, запас финансовой прочности в 2014 году составлял 16,5%, а в 2015 году 18,2%. В каком году деятельность предприятия была менее рискованной? Обоснуйте ответ.		хор. отл.

Оценочные средства по дисциплине разработаны в соответствии с Положением о фонде оценочных средств в ФГБОУ ВО «РЭУ им. Г.В.Плеханова».

<sup>1</sup> Приведены примеры из ФОС



- **Тематика курсовых работ**

Согласно учебному плану, по дисциплине «Управление рисками в деятельности компании» курсовая работа не предусмотрена.

- **Вопросы к зачету**

1. Понятие, сущность и назначение предпринимательской деятельности в современных экономических отношениях.
2. Экономическая природа риска, его классификация, основные черты.
3. Понятие предпринимательского и финансового риска в коммерческой деятельности. Причины возникновения рискованных ситуаций.
4. Подходы к классификации риска их характеристика.
5. Государственное регулирование и формирование финансовой среды предпринимательства.
6. Риск- менеджмент как составляющая управленческой деятельности.
7. Этапы и методы управления риском.
8. Сущность и назначение лимитирования и хеджирования.
9. Способы снижения рискованных явлений для коммерческих предприятий.
10. Отличительные особенности количественных и качественных методов оценки риска.
11. Использование методов «теории игр» и «оптимальности по Парето» в оценке рисков.
12. Использование методов «имитационного моделирования» и «расчета интегральных показателей» в оценке рисков.
13. Использование коэффициента VaR и Бета- коэффициента в оценке рисков.
14. Технология применения метода экспертных оценок в риск-менеджменте.
15. Технология применения метода «мозговая атака» в риск-менеджменте.
16. Технология применения синектического метода в риск-менеджменте.
17. Технология применения метода Делфи в риск-менеджменте.
18. Технология применения метода ПАТТЕРН в риск-менеджменте.
19. Технология применения метода аналогий в риск-менеджменте.
20. Качественные модели прогнозирования риска банкротства.
21. Краткая характеристика способов снижения предпринимательского риска.
22. Сущность диверсификации и диссипации риска.
23. Анализ и прогнозирование денежных потоков.
24. Учет рисков с использованием ставки дисконтирования.
25. Коммерческие, предпринимательские и финансовые риски как объект страховой защиты.
26. Сущность и принципы самострахования в коммерческом предприятии.
27. Страхование риска банкротства.
28. Страхование инвестиций.
29. Страхование риска арендных платежей и прибыли.
30. Страхование кредитных и банковских рисков.

**пример экзаменационного билета в Приложении 1**

- **Тематика эссе**

1. Каковы риски предпринимательства в Российской Федерации?
2. Роль риск-менеджмента в управлении предприятием.
3. Многообразие и особенности применения методов количественной оценки рисков.
4. Возможные варианты, типы финансовой политики, снижающие финансовый риск предприятия.
5. Особенности страхования рисков в зарубежных странах (на примере США, Германии, Китая, Японии).
6. Корпоративные финансовые риски: сущность, виды, величина, критерии степени риска. Способы снижения степени риска.

7. Финансовая работа и планирование: содержание, задачи, роль в вопросах снижения финансового риска

• **Тестовые задания**

**Тест многоуровневый по темам № 1-2**

1. Какой из факторов, оказывающих влияние на рыночное равновесие, относится к разряду неуправляемых?
- а) фактор инвестиционной привлекательности бизнеса;
  - б) фактор спроса;
  - в) фактор налогообложения;
  - г) фактор предложения.
2. К условиям прямого воздействия, влияющим на инвестиционную привлекательность относят:
- а) потребительский спрос;
  - б) степень риска вложения инвестиций;
  - в) качество управления;
  - г) инвестиционная стратегия.
3. Данный вид политического риска характеризуется принудительным выкупом властями имущества компании.
- а) риск национализации;
  - б) риск разрыва контракта;
  - в) риск трансферта;
  - г) риск протекционизма.
4. Данный риск подразделяют на региональный, международный, страховой.
- а) финансовый;
  - б) коммерческий;
  - в) отраслевой;
  - г) политический.
5. К техническим рискам относится:
- а) отрицательные результаты научно-исследовательских работ;
  - б) физический и моральный износ оборудования;
  - в) сбои и поломки в оборудовании;
  - г) увеличение расхода материальных затрат в результате перерасхода.
6. Что означает ситуация передачи ответственности FAS?
- а) риск и ответственность продавца переносятся на покупателя в момент передачи товара в условном месте;
  - б) продавец снимает с себя ответственность после выгрузки товара;
  - в) ответственность и риск за товар переходят от поставщика к покупателю согласно месту, обусловленному договором.
7. Группа рисков «С» характеризует:
- а) передачу ответственности за риск;
  - б) заключение договора транспортировки без принятия на себя риска продавца;
  - в) перенесение всех транспортных рисков на продавца.
8. Данный вид риска классифицируют по степени ответственности на группы: E,F,C,D
- а) финансовый риск;

- б) торговый риск;
- в) транспортный риск;
- г) производственный риск.

9. Анонимный опрос специалистов по заранее подготовленным вопросам с последующей статистической переработкой - это метод...

- а) метод Паттерн;
- б) метод «комиссий круглого стола»;
- в) матричный метод;
- г) метод Делфи.

10. Проведение метода Делфи осуществляется поочередно в несколько туров. Назовите количество их проведения.

- а) 3-5;
- б) 4-6;
- в) 7;
- г) 2.

11. Структурная визуализация планов предприятия – это метод..

- а) «снежного кома»;
- б) метод Делфи;
- в) дерево решений;
- г) матричный метод.

12. Погашение долговых кредитных обязательств в порядке увеличения суммы долга относится к методу:

- а) матричный;
- б) метод Делфи;
- в) снежного кома;
- г) дерево целей.

#### **Тест с открытыми вопросами по теме 4**

1. Если предприятие, имеющее значение ЭПЛ = 5, увеличит выручку от реализации на 2%, то что произойдет с прибылью от продаж и на какую величину она изменится?
2. Если сократится выручка от реализации на 4%, значение ЭПЛ = 2, то на сколько изменится прибыль от продаж?
3. Чему равен сопряженный эффект, если сила воздействия финансового рычага = 4, а сила воздействия операционного рычага = 3
4. Предположим, что коэффициент вариации в 2011 году составлял - 32%, а в 2012 году – 38%. Какой год был более рискованным для предприятия?
5. Предположим, запас финансовой прочности в 2009 году составлял 16,5%, а в 2010 году – 18,2%. В каком году деятельность предприятия была менее рискованной?

## VII. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Положение об интерактивных формах обучения (<http://www.rea.ru>)

Положение об организации самостоятельной работы магистрантов (<http://www.rea.ru>)

Положение о курсовых работах (<http://www.rea.ru>)

Положение о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний магистрантов (<http://www.rea.ru>)

Положение об учебно-исследовательской работе магистрантов в ФГБОУ ВО "РЭУ им. Г.В. Плеханова" (<http://www.rea.ru>)

<i>вид учебных занятий</i>	<i>Организация деятельности магистранта</i>
<i>Лекция</i>	<i>Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометить важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии. Уделить внимание следующим понятиям (перечисление понятий) и др.</i>
<i>Практические занятия</i>	<i>Проработка рабочей программы, уделяя особое внимание целям и задачам, структуре и содержанию дисциплины. Конспектирование источников. Работа с конспектом лекций, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы, работа с текстом (указать текст из источника и др.). Прослушивание аудио- и видеозаписей по заданной теме, решение расчетно-графических заданий, решение задач по алгоритму и др.</i>
<i>Контрольная работа / индивидуальные задания</i>	<i>Знакомство с основной и дополнительной литературой, включая справочные издания, зарубежные источники, конспект основных положений, терминов, сведений, требующихся для запоминания и являющихся основополагающими в этой теме. Составление аннотаций к прочитанным литературным источникам и др.</i>
<i>Реферат</i>	<i>Реферат: Поиск литературы и составление библиографии, использование от 3 до 5 научных работ, изложение мнения авторов и своего суждения по выбранному вопросу; изложение основных аспектов проблемы. Ознакомиться со структурой и оформлением реферата.</i>

## VIII. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И (ИЛИ) ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

### *Формирование балльной оценки по дисциплине «Управление рисками в деятельности компаний»*

В соответствии с «Положением о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний магистрантов в федеральном государственном бюджетном образовательном учреждении высшего профессионального образования «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова» распределение баллов, формирующих рейтинговую оценку работы магистранта, осуществляется следующим образом:

Виды работ	Максимальное количество баллов
Выполнение учебных заданий на аудиторных занятиях	20
Текущий и рубежный контроль	20
Творческий рейтинг	20
Промежуточная аттестация (экзамен/ зачет)	40
<b>ИТОГО</b>	<b>100</b>

#### 1. Текущий и рубежный контроль

Расчет баллов по результатам текущего и рубежного контроля в 2-м семестре:

Форма контроля	Наименование раздела/ темы, выносимых на контроль	Форма проведения контроля (тест, контр. работа и др. виды контроля в соответствии с Положением)	Количество баллов, максимально
1. Текущий и рубежный контроль	Тема 1. Процесс управления риском предпринимательской деятельности	Письменная домашняя работа	2
	Тема 2. Методы количественной оценки рисков	Письменная домашняя работа	2
		Анализ деловой ситуации	3
	Тема 3. Методы качественной оценки рисков	Письменная домашняя работа	2
	Тема 4. Способы снижения предпринимательских рисков	Анализ деловой ситуации	3
		Контрольная работа	3
	Все темы	Тестирование	5
<b>ИТОГО</b>			<b>20</b>

#### 2. Творческий рейтинг

Распределение баллов осуществляется по решению методической комиссии кафедры и результат распределения баллов за соответствующие виды работ представляются в виде следующей таблицы (в 2 семестре):

Наименование раздела/ темы дисциплины	Вид работы	Количество баллов
Тема 1. Процесс управления риском предпринимательской деятельности	Эссе / доклад с презентацией	5
Тема 2. Методы количественной оценки рисков	Эссе / доклад с презентацией	5
Тема 3. Методы качественной оценки рисков	Эссе / доклад с презентацией	5
Тема 4. Способы снижения предпринимательских рисков	Эссе / доклад с презентацией	5
<b>ИТОГО</b>		<b>20</b>

### 3. Промежуточная аттестация (экзамен/зачет)

Зачет по результатам изучения учебной дисциплины «Управление рисками в деятельности компании» в 2 семестре проводится в устной форме. Зачет осуществляется по билетам, включающим 2 теоретических вопроса. Возможно проведение зачета на основе выполнения индивидуальной исследовательской работы.

Оценка по результатам зачета выставляется исходя из следующих критериев:

- теоретические вопросы – по 20 баллов каждый.

**Итоговый балл** формируется суммированием баллов за промежуточную аттестацию и баллов, набранных перед аттестацией в течение семестра. Приведение суммарной балльной оценки к четырехбалльной шкале производится следующим образом:

#### Показатели и критерии оценивания планируемых результатов освоения компетенций и результатов обучения, шкала оценивания

100-балльная система оценки	Традиционная четырехбалльная система оценки	Формируемые компетенции (индикаторы компетенций)	Критерии оценивания
85 – 100 баллов	«отлично»	ПК-4	<p><b>Знает верно и в полном объеме:</b> основные официальные методические документы, регламентирующие инвестиционную и оценочную деятельность и проведение оценочных работ в Российской Федерации; особенности проведения оценки стоимости бизнеса для конкретных целей: инвестирования капитала, налогообложения, реструктуризации и антикризисного управления</p> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b> сформулировать цель оценки и приоритеты использования методов для конкретных целей оценки и особенностей оцениваемого бизнеса</p> <p><b>Владет навыками верно и в полном объеме:</b> количественными и качественными методами для проведения оценки бизнеса,</p>

			готовить аналитические материалы по результатам их применения
		ПК-5	<p><b>Знает верно и в полном объеме:</b> основные методы оценки бизнеса: доходный, сравнительных продаж, накопленных активов; основные виды рисков, связанных с принятием решений об инвестициях с целью повышения стоимости бизнеса;</p> <p><b>Умеет верно и в полном объеме:</b> использовать методы технического и фундаментального анализа с целью оценки текущей и справедливой рыночной стоимости бизнеса; уметь принимать решения, связанные с управлением стоимостью капитала и стоимостью бизнеса</p> <p><b>Владет навыками верно и в полном объеме:</b> навыками оценки бизнеса, инновационно-инвестиционных программ и управления стоимостью бизнеса</p>
70 – 84 баллов	«хорошо»	ПК-4	<p><b>Знает с незначительными замечаниями:</b> основные официальные методические документы, регламентирующие инвестиционную и оценочную деятельность и проведение оценочных работ в Российской Федерации; особенности проведения оценки стоимости бизнеса для конкретных целей: инвестирования капитала, налогообложения, реструктуризации и антикризисного управления</p> <p><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b> сформулировать цель оценки и приоритеты использования методов для конкретных целей оценки и особенностей оцениваемого бизнеса</p> <p><b>Владет навыками с незначительными замечаниями:</b> количественными и качественными методами для проведения оценки бизнеса, готовить аналитические материалы по результатам их применения</p>
		ПК-5	<p><b>Знает с незначительными замечаниями:</b> основные методы оценки бизнеса: доходный, сравнительных продаж, накопленных активов; основные виды рисков, связанных с принятием решений об инвестициях с целью повышения стоимости бизнеса;</p> <p><b>Умеет с незначительными замечаниями:</b> использовать методы технического и</p>

			<p>фундаментального анализа с целью оценки текущей и справедливой рыночной стоимости бизнеса; уметь принимать решения, связанные с управлением стоимостью капитала и стоимостью бизнеса</p> <p><b>Владеет навыками с незначительными замечаниями:</b> навыками оценки бизнеса, инновационно-инвестиционных программ и управления стоимостью бизнеса</p>
50 – 69 баллов	«удовлетворительно»	ПК-4	<p><b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b> основные официальные методические документы, регламентирующие инвестиционную и оценочную деятельность и проведение оценочных работ в Российской Федерации; особенности проведения оценки стоимости бизнеса для конкретных целей: инвестирования капитала, налогообложения, реструктуризации и антикризисного управления</p> <p><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b> сформулировать цель оценки и приоритеты использования методов для конкретных целей оценки и особенностей оцениваемого бизнеса</p> <p><b>Владеет на базовом уровне, с ошибками:</b> количественными и качественными методами для проведения оценки бизнеса, готовить аналитические материалы по результатам их применения</p>
		ПК-5	<p><b>Знает на базовом уровне, с ошибками:</b> основные методы оценки бизнеса: доходный, сравнительных продаж, накопленных активов; основные виды рисков, связанных с принятием решений об инвестициях с целью повышения стоимости бизнеса;</p> <p><b>Умеет на базовом уровне, с ошибками:</b> использовать методы технического и фундаментального анализа с целью оценки текущей и справедливой рыночной стоимости бизнеса; уметь принимать решения, связанные с управлением стоимостью капитала и стоимостью бизнеса</p> <p><b>Владеет на базовом уровне, с ошибками:</b> навыками оценки бизнеса, инновационно-инвестиционных программ и управления стоимостью бизнеса</p>
менее 50 баллов	«неудовлетворительно»	ПК-4	<p><b>Не знает на базовом уровне:</b> основные официальные методические документы, регламентирующие инвестиционную и оценочную деятельность и проведение оценочных работ в Российской Федерации; особенности проведения оценки</p>



			<p>стоимости бизнеса для конкретных целей: инвестирования капитала, налогообложения, реструктуризации и антикризисного управления</p> <p><b>Не умеет на базовом уровне:</b> сформулировать цель оценки и приоритеты использования методов для конкретных целей оценки и особенностей оцениваемого бизнеса</p> <p><b>Не владеет на базовом уровне:</b> количественными и качественными методами для проведения оценки бизнеса, готовить аналитические материалы по результатам их применения</p>
		ПК-5	<p><b>Не знает на базовом уровне:</b> основные методы оценки бизнеса: доходный, сравнительных продаж, накопленных активов; основные виды рисков, связанных с принятием решений об инвестициях с целью повышения стоимости бизнеса;</p> <p><b>Не умеет на базовом уровне:</b> использовать методы технического и фундаментального анализа с целью оценки текущей и справедливой рыночной стоимости бизнеса; уметь принимать решения, связанные с управлением стоимостью капитала и стоимостью бизнеса</p> <p><b>Не владеет на базовом уровне:</b> навыками оценки бизнеса, инновационно-инвестиционных программ и управления стоимостью бизнеса</p>

**Приложение 1**  
**Пример зачетного билета**

Министерство образования и науки Российской Федерации федеральное государственное  
бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова»  
Факультет Менеджмента  
Кафедра Экономического анализа и статистики

БИЛЕТ № 1  
по дисциплине «Управление рисками в деятельности компании»  
Направление 38.04.02 Менеджмент  
Профиль/Программа «Магистр делового администрирования»

1. Экономическая природа риска, его классификация, основные черты.	ПК-4, ПК-5
2. Технология применения метода Делфи в риск-менеджменте	ПК-4, ПК-5

Утверждено на заседании кафедры Экономического анализа и статистики, протокол № 8 от «25» апреля 2019 г.

Заведующий кафедрой



/ Лунева М.Н., к.э.н./

## Приложение 2

### ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

№ п/п	Наименование разделов и тем	Контактные часы								Самостоятельна я работа		Формы текущего/ рубежного контроля
		Аудиторные часы						Конт. часы по промеж у точной аттес тации (Катт)	Конт. часы по промежут очной аттес тации и в период экз.сессии (Каттэк)	формы	часы	
		Лекции	Практи- ческие занятия	Лабор а- торны е работ ы	Всего ауд.	в том числе интерактивные						
								формы	часы			
1	Процесс управления риском предпринимате льской деятельности	2	2		4					лит., подг. докл., напис ание эссе	22	Опрос
2	Методы оценки предпринимате льских рисков	2	2		4	А.д.с., р.а.з	4			лит., подг. докл., напис ание эссе	22	Проверка письменн ых заданий, тестирова ние
3	Способы снижения предпринимате льских рисков	2	2		4	А.д.с., р.а.з.	4			лит., р.а.з.	22	Опрос
4	Финансовые риски и управление ими на предприятии	2	4		6	А.д.с., р.а.з.	4			лит., п.з.	22	Опрос, проверка письменн ых заданий
Итого:		8	16		24		12	2			118	Зачетс оценкой
Всего по дисциплине 108часов		8	16		24		12	2			118	

**Карта обеспеченности дисциплины «Управление рисками в деятельности компании»  
учебными изданиями и иными информационно-библиотечными ресурсами**

Кафедра Экономического анализа и статистики

ОПОП ВО по программе магистратуры 38.04.02 МЕНЕДЖМЕНТ,

Магистерская программа Магистр делового администрирования

Уровень подготовки Академическая магистратура

№ п/п	Наименование, автор	Выходные данные	Библиотека Пермского института (филиала) РЭУ им Г.В.Плеханова		Количество экземпляров на кафедре (в лаборатории ) (шт.)	Числен- ность студент ов (чел.)	Показатель обеспеченности студентов литературой: = 1 (при наличии в ЭБС); или =(колонка 4/ колонка 7) (при отсутствии в ЭБС)
			количество печатных экземпляро в (шт.)	наличие в ЭБС (да/нет), название ЭБС			
1	2	3	4	5	6	7	8
<b>Основная литература</b>							
1.	Управление рисками в инновационно- инвестиционной деятельности предприятия / Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С., -	3-е изд. - М.:Дашков и К, 2017. - 418 с.: ISBN 978-5-394-02256-2 - Режим доступа: <a href="http://znanium.com/catalog/product/415224">http://znanium.com/catalog/product/415224</a>	X	да, ЭБС «ZNANIUM»	X	X	<b>1,0</b>
2.	Управление рисками предприятия : учебное пособие / В.Н. Уродовских. —	М. : Вузовский учебник, ИНФРА-М, 2017. — 168 с.	X	да, ЭБС «ZNANIUM»	X	X	<b>1,0</b>
	<b>Всего</b>						
<b>Дополнительная литература</b>							
1.	Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: Пособие / Шапкин А.С.,	-е изд. - М.:Дашков и К, 2018. - 544 с.: 60x84 1/16 ISBN 978-5- 394-02150-3 - Режим доступа: <a href="http://znanium.com/catalog/product/339372">http://znanium.com/catalog/product/339372</a>	X	да, ЭБС «ZNANIUM»	X	X	<b>1,0</b>

	Шапкин В.А., - 9						
2.	Механизм комплексной оценки и управления рисками предприятий промышленности: Монография / Дзагоева М.Р., Цховребов А.Р., Комаева Л.Э. -	М.:НИЦ ИНФРА-М, 2017. - 120 с.: 60х90 1/16. - (Научная мысль) (Обложка. КБС) ISBN 978-5-16-009698-8	X	да, ЭБС «ZNANIUM»	X	X	1,0
3.	Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. —	М. : ИНФРА-М, 2017. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — <a href="http://www.dx.doi.org/10.12737/6216">www.dx.doi.org/10.12737/6216</a> .	X	да, ЭБС «ZNANIUM»	X	X	1,0
4.	Управление рисками на предприятии : учебное пособие / С.М. Васин, В.С. Шутов. —	Москва : КноРус, 2018. — 299 с. — ISBN 978-5-406-06112-1.	X	да, ЭБС «BOOK.ru»	X	X	1,0
5.	Уколов, А.И. Управление корпоративными рисками: инструменты хеджирования : учебник / А.И. Уколов, Т.Н. Гупалова. -	2-е изд., стер. - Москва : Директ-Медиа, 2017. - 554 с. : ил., схем., табл. - Библиогр.: с. 547. - ISBN 978-5-4475-9318-6 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <a href="http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=273678">http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=273678</a> (19.11.2018).	X	да, ЭБС «Университетская библиотека онлайн»	X	X	1,0
6.	Уколов, А.И. Оценка рисков : учебник / А.И. Уколов. -	2-е изд. стер. - Москва : Директ-Медиа, 2018. - 627 с. : ил., схем., табл. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-4475-2589-7 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <a href="http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=445268">http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=445268</a> (19.11.2018).	X	да, ЭБС «Университетская библиотека онлайн»	X	X	1,0
	<b>Всего</b>						
<b>Профессиональные базы данных, информационно-справочные системы</b>							

1.	Справочная и поисковая система Консультант +		X	X	X	X	1,0
2.	Справочная и поисковая система Гарант		X	X	X	X	1,0
3.	Научная Электронная библиотека «elibrary.ru»		X	X	X	X	1,0
	<b>Всего</b>						

Зав. кафедрой



/Лунёва М. Н./

«25» апреля 2019 г.

.

Согласовано:

Зав. библиотекой



/Любимова Л. Б./

«25» апреля 2019 г.

.

