Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Гриб Владислав Валерьевич
Должность: Ректор
Дата подписания: 29.09.2026 16:28:18
Уникальный программный ключ:
637517d24e103c3db032acf[illegible]

Образовательное частное учреждение высшего образования
«МОСКОВСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ А.С. ГРИБОЕДОВА»
(ИМПЭ им. А.С. Грибоедова)

МЕЖДУНАРОДНЫЙ ИНСТИТУТ ИННОВАЦИОННОЙ ЭКОНОМИКИ, ЛИДЕРСТВА И МЕНЕДЖМЕНТА

УТВЕРЖДАЮ
Директор Международного института инновационной экономики, лидерства и менеджмента
_____ А. А. Панарин
«17» декабря 2025г.

Рабочая программа дисциплины

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ОРГАНИЗАЦИИ

Направление подготовки
38.03.01 Экономика
(уровень бакалавриат)

Направленность/профиль:
«Экономика организаций»

Формы обучения: очная, очно-заочная, заочная

Москва

Рабочая программа дисциплины «Управление рисками организации». Направление подготовки 38.03.01 Экономика, направленность (профиль): «Экономика организаций» / Т. А. Борисовская. – М.: ИМПЭ им. А.С. Грибоедова

Рабочая программа дисциплины составлена на основании федерального государственного образовательного стандарта высшего образования – бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 12 августа 2020 г. № 954 и Профессионального стандарта «Экономист предприятия» от «30» марта 2021 г. № 161н (зарегистрирован Министерством юстиции Российской Федерации «29» апреля 2021 г., регистрационный № 63289).

Разработчики	Т. А. Борисовская, к. э. н., доцент
Ответственный рецензент	А. В. Кравченко, доктор экономических наук, доцент, декан экономического факультета Автономной некоммерческой организации высшего образования «Московский гуманитарно-экономический университет»
	(Ф.И.О., уч. степень, уч. звание, должность)

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и одобрена на заседании кафедры финансов, экономики и организации производства 17.12.2025г., протокол №6

Заведующий кафедрой _____/ Т. В. Новикова, к. э. н., доцент

Согласовано от Библиотеки _____/ О. Е. Стёпкина

Раздел 1. Цель и задачи освоения дисциплины

Основной ***целью*** дисциплины является формирование целостного представление о системе концепций, моделей и методов, лежащих в основе анализа экономических рисков предпринимательской деятельности и разработки систем управления рисками.

Задачами дисциплины являются:

- изучение теоретических подходов к классификации и анализу рисков предпринимательской деятельности;
- систематизация современных знаний в различных областях управления рисками;
- изучение отечественного и зарубежного опыта управления риском в предпринимательских организациях различных организационно-правовых форм;
- овладение основными подходами к решению задач анализа и управления предпринимательскими рисками;
- овладение методами обоснования, подготовки и осуществления управленческих решений в условиях риска;
- формирование навыков разработки и совершенствования систем риск-менеджмента компаний;
- отработка знаний, умений и навыков исследовательской деятельности.

Раздел 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код компетенции	Формулировка компетенции	Индикаторы достижения компетенции
УК-10	Способен принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности	**ИУК-10.1. Знает** основные методы и принципы принятия обоснованных экономических решений в различных областях жизнедеятельности **ИУК-10.2. Умеет** принимать обоснованные экономические решения в различных областях жизнедеятельности **ИУК-10.3. Владеет** методами и принципами принятия обоснованных экономических решений в различных областях жизнедеятельности

Раздел 3. Место дисциплины в структуре образовательной программы бакалавриата

Дисциплина «Управление рисками организации» изучается в 4 семестре очной и в 7 семестре очно-заочной и заочной форм обучения, относится к Блоку Б.1 «Дисциплины (модули)», «Элективные дисциплины», образовательной программы по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриат), направленность (профиль): «Экономика организаций».

Раздел 4. Объем (трудоемкость) дисциплины (общая, по видам учебной работы, видам промежуточной аттестации)

Трудоемкость дисциплины и виды учебной работы

на очной форме обучения

з.е.	Итого	Лекции	Практические занятия	Курсовое проектирование	Самостоятельная работа	Текущий контроль	Контроль, промежуточная аттестация
4 семестр							

5	180	32	48		64		36 Экзамен

на очно-заочной форме обучения

з.е.	Итого	Лекции	Практические занятия	Курсовое проектирование	Самостоятельная работа	Текущий контроль	Контроль, промежуточная аттестация
7 семестр							
5	180	12	16		116		36 Экзамен

на заочной форме обучения

з.е.	Итого	Лекции	Практические занятия	Курсовое проектирование	Самостоятельная работа	Текущий контроль	Контроль, промежуточная аттестация
7 семестр							
5	180	8	8		128		36 Экзамен

Тематический план дисциплины

Очная форма обучения

Разделы / Темы	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	Текущий контроль	Контроль, промежуточная аттестация	Всего часов
4 семестр						
Тема 1. Теоретические подходы к изучению рисков	2	4	6			12
Тема 2. Организация риск-менеджмента	2	4	6			12
Тема 3. Построение систем риск-менеджмента	2	4	6			12
Тема 4. Концепция интегрированного риск-менеджмента	2	4	6			12
Тема 5. Основы управления финансовыми рисками	2	4	6			12
Тема 6. Управление валютными рисками	2	4	6			12
Тема 7. Управление процентным риском	2	4	6			12
Тема 8. Управление кредитными рисками	2	4	6			12
Тема 9. Методы управления страновыми рисками	4	4	4			12
Тема 10. Управление рисками реальных инвестиционных проектов	4	4	4			12
Тема 11. Современные	4	4	4			12

методы управления рисками финансового инвестирования.						
Тема 12. Управление рисками банкротства	4	4	4			12
Экзамен					36	36
Итого по дисциплине	**32**	**48**	**64**		**36**	**180**

Очно-Заочная форма обучения

Разделы / Темы	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	Текущий контроль	Контроль, промежуточная аттестация	Всего часов
7 семестр						
Тема 1. Теоретические подходы к изучению рисков	2	2	10			14
Тема 2. Организация риск-менеджмента			10			10
Тема 3. Построение систем риск-менеджмента	2	2	10			14
Тема 4. Концепция интегрированного риск-менеджмента		2	8			10
Тема 5. Основы управления финансовыми рисками	2	2	10			14
Тема 6. Управление валютными рисками			10			10
Тема 7. Управление процентным риском	2		8			10
Тема 8. Управление кредитными рисками		2	10			12
Тема 9. Методы управления страновыми рисками	2	2	10			14
Тема 10. Управление рисками реальных инвестиционных проектов		2	10			12
Тема 11. Современные методы управления рисками финансового инвестирования.	2		10			12
Тема 12. Управление рисками банкротства		2	10			12
Экзамен					36	36
Итого по дисциплине	**12**	**16**	**116**		**36**	**180**

Заочная форма обучения

Разделы / Темы	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	Текущий контроль	Контроль, промежуточная аттестация	Всего часов
7 семестр						
Тема 1. Теоретические	2	2	10			14

подходы к изучению рисков						
Тема 2. Организация риск-менеджмента			10			10
Тема 3. Построение систем риск-менеджмента	2	2	10			14
Тема 4. Концепция интегрированного риск-менеджмента			10			10
Тема 5. Основы управления финансовыми рисками	2	2	10			14
Тема 6. Управление валютными рисками			10			10
Тема 7. Управление процентным риском			10			10
Тема 8. Управление кредитными рисками			12			12
Тема 9. Методы управления страновыми рисками	2	2	10			14
Тема 10. Управление рисками реальных инвестиционных проектов			12			12
Тема 11. Современные методы управления рисками финансового инвестирования.			12			12
Тема 12. Управление рисками банкротства			12			12
Экзамен					36	36
Итого по дисциплине	**8**	**8**	**128**		**36**	**180**

Структура и содержание дисциплины

№ п/п	Наименование раздела\темы	Содержание темы
1	Тема 1. Теоретические подходы к изучению рисков	Аксиомы рискологии. Постулаты рискологии**.** Назначение рискологии. Рискология как комплекс мероприятий по выявлению, оценке, профилактике и минимизации предпринимательских рисков. Природа возникновения риска. Виды неопределенности. Теории риска: классическая теория предпринимательских рисков, неоклассическая теория предпринимательских рисков, неоклассическая «кейнсианская» теория предпринимательских рисков. Функция полезности. Сущность экономического риска. Ситуация риска. Осознание риска. Функции предпринимательских рисков. Концепция приемлемого риска.
2	Тема 2. Организация риск-менеджмента	Содержание риск-менеджмента. Составляющие элементы риск-менеджмента: стратегия, тактика. Подсистемы системы управления риском: управляющая подсистема, объект управления. Функции субъекта управления. Функции объекта управления. Процедуры управления рисками. Приемы риск-менеджмента. Средства разрешения риска: избежание, передача, удержание. Общие этапы процесса

		управления рисками. Уровни управления рисками. Идентификация рисков. Оценка рисков и результатов их воздействия на бизнес компании. Процесс оценки риска. Идентификация риска. Анализ риска. Сравнительная оценка риска. Применение оценки риска на различных стадиях жизненного цикла. Выбор метода. Факторы, влияющие на выбор методов оценки: доступность ресурсов, характер и степень неопределенности данных и информации, сложность метода. Виды методов оценки риска. Ключевые методы оценки рисков. Затраты на риск. Источники финансирования риска. Структура затрат при различных методах управления риском.
3	Тема 3. Построение систем риск-менеджмента	Последовательность разработки системы риск-менеджмента. Организация и разработка общей политики риск-менеджмента. Место подразделений риск-менеджмента. Особенности стандартов риск-менеджмента. Стандарт управления рисками FERMA. Стандарт риск-менеджмента COSO. Международный стандарт ИСО 31000:2009 «Менеджмент риска. Принципы и руководство». Подходы к построению системы управления рисками. Централизованная структура. Преимущества и недостатки. Децентрализованная структура. Преимущества и недостатки. Факторы выбора структуры системы управления рисками. Общие критерии сравнения эффективности структур систем управления рисками. Общие рекомендации по формированию эффективной системы управления рисками. Ключевые аспекты эффективной системы риск-менеджмента. Оценка эффективности систем управления рисками. Общие подходы к оценке эффективности методов управления риском. Направления совершенствования систем управления рисками.
4	Тема 4. Концепция интегрированного риск-менеджмента	Предпосылки возникновения концепции интегрированного управления рисками, как новой стратегии управления. Главная цель интегрированного риск-менеджмента. Главный принцип корпоративного риск-менеджмента. Ключевые составляющие: организационное сопровождение; методологическое обеспечение; информационно-аналитические системы. Функции управления рисками на предприятии. Определение склонности к риску и выбор «профиля риска». Карта рисков. Количественная оценка совокупного риска. Концепция экономической добавленной стоимости EVA. Достоинства показателя EVA. Недостатки показателя EVA. Скорректированная на риск рентабельность капитала – RAROC. Достоинства показателя RAROC. Слабые стороны RAROC.
5	Тема 5. Основы управления финансовыми рисками	Классификация финансовых рисков. Чистые и спекулятивные риски. Характеристики категории финансового риска. Характеристика основных финансовых рисков. Виды финансовых рисков. Уровни финансовых рисков. Коэффициент риска. Управление финансовыми рисками. Задачи управления финансовыми рисками. Принципы управления финансовыми рискам. Меры избежания финансовых рисков. Механизмы передачи риска.

		Особенности удержания риска. Приемы снижения степени риска: приобретение дополнительной информации о выборе и результатах, лимитирование, диверсификация, самострахование, хеджирование, страхование, приобретение контроля над деятельностью в связанных областях. Преимущества и недостатки приемов снижения степени риска, особенности применения на практике. Финансирование риска. Основные источники финансирования. Оценка эффективности управления риском.
6	Тема 6. Управление валютными рисками	Формирование валютных курсов Меры государственного воздействия на величину валютного курса. Понятие валютного риска. Стратегий управления валютным риском: стратегия непокрытия валютных рисков; стратегия полного хеджирования валютных рисков; стратегия избирательного хеджирования валютных рисков. Виды валютного риска: операционный, трансляционный, экономический. Управление операционным валютным риском. Внутренние методы и процедуры управления операционным валютным риском. Внешнее хеджирование операционного валютного риска. Операции СВОП. Хеджирование с помощью форвардных контрактов. Хеджирование с помощью фьючерсных контрактов на организованных рынках. Хеджирование с помощью валютных опционов. Страхование. Управление трансляционным валютным риском. Методы управления валютным трансляционным риском организации (банка): коррекция потоков валютных фондов; заключение форвардных контрактов на продажу или покупку инвалюты; неттинг риска. Управление экономическим валютным риском. Стратегия управления валютным экономическим риском. Выравнивание денежных потоков. Глобальная диверсификация. Стратегии финансирования.
7	Тема 7. Управление процентным риском	Риск процентной ставки, или процентный риск. Факторы, влияющие на чистый доход в виде процентов. Разновидности риска изменения процентных ставок. Источники процентного риска. Составляющие процентного риска. Основные формы процентного риска: Процентный риск для финансовых учреждений. Базовый риск. Риск временного разрыва. Методы оценки процентного риска. Метод анализа разрывов между активами и пассивами (gap-анализ). Активы, чувствительные к изменению процентных ставок. Активы, не чувствительные к изменению процентных ставок. Пассивы, чувствительные к изменению процентной ставки. Пассивы, не чувствительные к изменению процентной ставки. Абсолютный GAP. Относительный GAP. Достоинства и недостатки метода. Метод дюрации. Преимущества и недостатки метода. Метод имитационного моделирования.
8	Тема 8. Управление кредитными рисками	Кредитный риск. Структура кредитного риска: страновой риск, риск контрагента**.** Группы кредитного риска по источнику появления: внешний риск, внутренний риск. Состав внешнего риска. Состав внутреннего риска.

		Эволюция подходов к оценке кредитного риска. Показатели оценки кредитного риска. Кредитное событие. Дефолт. Виды кредитного события по определению ISDA (Международной ассоциации дилеров по свопам и производным инструментам). Кредитный риск банка. Управление кредитным риском. Задачи управления риском. Классический анализ кредитоспособности заемщика. Аналитические коэффициенты, используемые для оценки кредитоспособности заемщика. Кредитные рейтинги. Шкала кредитных рейтингов основных рейтинговых агентств. Качество облигаций. Критерии определения кредитного рейтинга. Элементы управления кредитным риском. Цель управления кредитными рисками. Этапы управления кредитным риском: идентификация риска; количественная оценка риска; мониторинг риска; принятие решения об изменении уровня риска; выбор и реализация мер по снижению (увеличению) риска; контроль за уровнем риска и эффективностью принятых мер. Кредитная стратегия. Основные способы управления подверженностью кредитному риску.
9	Тема 9. Методы управления страновыми рисками	Страновые риски. Страновой экономический риск. Страновой финансовый риск. Страновые валютные риски. Политический риск. Качественные методы анализа страновых рисков. Рейтинговые системы анализа страновых рисков. Аналитические методы оценки страновых рисков. Основные направления управления политическими рисками. Управление политическими рисками коммерческой деятельности на зарубежных рынках. Методы управления политическими рисками зарубежного инвестирования. Страхование инвестиций от политических рисков. Основные факторы, определяющие перечень страхуемых рисков. Деятельность национальных и международных агентств по страхованию рисков. Деятельность многостороннего агентства по гарантированию инвестиций МИГА. Частное страхование от политических рисков. Практика страхования инвестиционных рисков. Оценка экономической эффективности страхования инвестиционных рисков.
10	Тема 10. Управление рисками реальных инвестиционных проектов	Основные принципы разработки инвестиционных проектов. Структура инвестиционных рисков. Группы проектных рисков по этапам осуществления проекта. Риск и неопределенность в инновационной среде. Риски инновационного развития. Риски инвестирования, реализации и эксплуатации. Учет неопределенности инвестиционных проектов. Методы оценки инвестиционных рисков. Методы оценки рисков в инновационном бизнесе. Менеджмент риска проектирования реальных инвестиционных проектов. Процессы менеджмента риска при проектировании. Определение ситуации. Идентификация риска. Оценка риска. Обработка риска. Исследование и мониторинг риска Методы оценки ставки дисконта. Модифицированная модель оценки капитальных активов. Фундаментальный коэффициент бета. Метод кумулятивного построения ставки дисконта. Методика

		HAZOP. Особенности HAZOP-экспертизы.
11	Тема 11. Современные методы управления рисками финансового инвестирования.	Структура процентных ставок с учетом рисков. Кривая доходностей. Модели оценки цены и риска облигаций. Дюрация, выпуклость, волатильность. Процентные риски облигаций. Модели оценки цены и риска акций. Рыночный и собственный риск. Модель CAPM. Предположения модели. Коэффициент относительного риска. Оценка показателя VaR. Стратегии портфельного инвестирования. Диверсификация в портфельном инвестировании. Оптимизация портфеля ценных бумаг по соотношению доходность – риск. Способы измерения финансовых рисков портфельных инвестиций. Дюрация и иммунизация портфеля. Управление рыночным риском портфелей акций, облигаций и производных финансовых инструментов. Методы хеджирования рисков портфеля ценных бумаг. Применение производных финансовых инструментов для управления финансовыми рисками. Хеджирование, его экономическая целесообразность. Хеджирование фьючерсными контрактами. Биржевые опционы и их свойства. Основные спрэды и комбинации опционов. Дельта-хеджирование. Гамма-хеджирование.
12	Тема 12. Управление рисками банкротства	Понятие несостоятельности (банкротства) предприятия. Закон РФ от 26.10.2002 г. «О несостоятельности (банкротстве) предприятия». Причины возникновения состояния банкротства. Объективные причины возникновения банкротства. Субъективные причины возникновения банкротства. Прогнозирование возможности банкротства посредством финансового анализа конкретных параметров деятельности компании. Достоинство метода. Система критериев для определения неудовлетворительной структуры баланса неплатежеспособного предприятия. Метод анализа финансовых потоков. Метод использования системы специальных критериев. Достоинства. Недостатки. Группы показателей признаков банкротства. Модели Альтмана. Двухфакторная модель Альтмана. Пятифакторные модели Альтмана для акционерных обществ. Модель ZETA. Области применения Z-модели и модели ZETA. Модифицированные модели. Специфика российских условий. Двухфакторная модель для оценки риска банкротства предприятий среднего класса производственного типа. Четырехфакторная модель прогноза риска банкротства предприятий торговли (модель R-счета). Особенности моделей прогнозирования риска банкротства. Минимизация угрозы банкротства. Финансовые способы минимизации. Производственные способы. Мероприятия по санации.

Занятия семинарского типа
(Практические занятия)

Общие рекомендации по подготовке к практическим занятиям. При подготовке к работе во время проведения занятий практического типа следует обратить внимание на следующие моменты: на процесс предварительной подготовки, на работу во время занятия,

обработку полученных результатов, исправление полученных замечаний. Предварительная подготовка к учебному занятию практического типа заключается в изучении теоретического материала в отведенное для самостоятельной работы время, ознакомление с инструктивными материалами с целью осознания задач занятия.

Работа во время проведения занятия практического типа включает несколько моментов: а) консультирование обучающихся преподавателями с целью предоставления исчерпывающей информации, необходимой для самостоятельного выполнения предложенных преподавателем задач; б) самостоятельное выполнение заданий согласно обозначенной учебной программой тематики.

Тема 1. Теоретические подходы к изучению рисков

Вопросы и/или задания

1. Аксиомы рискологии.
2. Рискология как комплекс мероприятий по выявлению, оценке, профилактике и минимизации предпринимательских рисков.
3. Виды неопределенности.
4. Что такое риск и как он влияет на деятельность страховой компании?
5. Какие теоретические подходы существуют к изучению рисков в страховании?
6. Какова роль статистических методов в анализе рисков и как они используются в страховании?
7. Какие факторы влияют на уровень риска и как они учитываются при оценке страхового риска?

Тема 2. Организация риск-менеджмента

Вопросы и/или задания

1. Содержание риск-менеджмента.
2. Приемы риск-менеджмента.
3. Средства разрешения риска: избежание, передача, удержание.
4. Что такое риск-менеджмент и какова его роль в страховой деятельности?
5. Какие этапы существуют в процессе организации риск-менеджмента?
6. Каковы основные принципы организации риск-менеджмента и как они влияют на его эффективность?
7. Какие методы управления рисками существуют в страховании и какова их эффективность?

Тема 3. Построение систем риск-менеджмента

Вопросы и/или задания

1. Место подразделений риск-менеджмента.
2. Организация и разработка общей политики риск-менеджмента.
3. Последовательность разработки системы риск-менеджмента
4. Что такое системы риск-менеджмента и какова их роль в страховой деятельности?
5. Какие этапы существуют в процессе построения системы риск-менеджмента?
6. Каковы основные принципы построения системы риск-менеджмента и как они влияют на ее эффективность?
7. Какие методы анализа и оценки рисков существуют в страховании и какова их эффективность?
8. Каковы последствия неправильной оценки или управления рисками для страховой компании и ее клиентов?

Тема 4. Концепция интегрированного риск-менеджмента

Вопросы и/или задания

1. Предпосылки возникновения концепции интегрированного управления рисками, как новой стратегии управления.
2. Количественная оценка совокупного риска.

3. Слабые стороны RAROC.
4. Что такое концепция интегрированного риск-менеджмента и какова ее роль в страховой деятельности?
5. Какие принципы лежат в основе интегрированного риск-менеджмента и как они влияют на его эффективность?
6. Какие методы и инструменты используются в рамках интегрированного риск-менеджмента и какова их роль?
7. Какие проблемы могут возникнуть при реализации концепции интегрированного риск-менеджмента и как они решаются?

Тема 5. Основы управления финансовыми рисками

Вопросы и/или задания

1. Чистые и спекулятивные риски.
2. Уровни финансовых рисков. Коэффициент риска.
3. Виды финансовых рисков.
4. Что такое финансовые риски и какова их роль в экономике?
5. Какие виды финансовых рисков существуют и какова их классификация?
6. Каковы основные принципы управления финансовыми рисками и как они влияют на эффективность бизнеса?
7. Какие методы оценки и управления финансовыми рисками существуют и какова их эффективность?
8. Каковы последствия неправильной оценки или управления финансовыми рисками и как они предотвращаются?

Тема 6. Управление валютными рисками

Вопросы и/или задания

1. Формирование валютных курсов Меры государственного воздействия на величину валютного курса.
2. Виды валютного риска: операционный, трансляционный, экономический.
3. Хеджирование с помощью валютных опционов.
4. Страхование.
5. Что такое валютные риски и какова их роль в экономике?
6. Какие виды валютных рисков существуют и какова их классификация?
7. Каковы основные принципы управления валютными рисками и как они влияют на эффективность бизнеса?
8. Какие методы оценки и управления валютными рисками существуют и какова их эффективность?
9. Каковы последствия неправильной оценки или управления валютными рисками и как они предотвращаются?

Тема 7. Управление процентным риском

Вопросы и/или задания

1. Активы, не чувствительные к изменению процентных ставок.
2. Метод имитационного моделирования.
3. Преимущества и недостатки метода.
4. Что такое процентный риск и какова его роль в банковской деятельности?
5. Какие виды процентных рисков существуют и какова их классификация?
6. Каковы основные принципы управления процентным риском и как они влияют на эффективность банковской деятельности?
7. Какие методы оценки и управления процентным риском существуют и какова их эффективность?

Тема 8. Управление кредитными рисками

Вопросы и/или задания

1. Состав внутреннего риска.
2. Аналитические коэффициенты, используемые для оценки кредитоспособности заемщика.
3. Основные способы управления подверженностью кредитному риску.
4. Что такое кредитный риск и какова его роль в банковской деятельности?
5. Какие виды кредитных рисков существуют и какова их классификация?
6. Каковы основные принципы управления кредитными рисками и как они влияют на эффективность банковской деятельности?
7. Какие методы оценки и управления кредитными рисками существуют и какова их эффективность?

Тема 9. Методы управления страновыми рисками

Вопросы и/или задания

1. Качественные методы анализа страновых рисков.
2. Основные направления управления политическими рисками.
3. Методы управления политическими рисками зарубежного инвестирования.
4. Что такое страновые риски и какова их роль в международных инвестициях?
5. Какие методы управления страновыми рисками существуют и какова их эффективность?
6. Каковы основные принципы управления страновыми рисками и как они влияют на эффективность инвестиций?
7. Какие проблемы могут возникнуть при управлении страновыми рисками и как они решаются?
8. Каковы перспективы развития методов управления страновыми рисками и какие вызовы существуют в этой области?

Тема 10. Управление рисками реальных инвестиционных проектов

Вопросы и/или задания

1. Риски инновационного развития.
2. Метод кумулятивного построения ставки дисконта.
3. Методы оценки ставки дисконта
4. Что такое риски реальных инвестиционных проектов и какова их роль в инвестиционной деятельности?
5. Какие виды рисков реальных инвестиционных проектов существуют и какова их классификация?
6. Каковы основные принципы управления рисками реальных инвестиционных проектов и как они влияют на их эффективность?
7. Какие методы оценки и управления рисками реальных инвестиционных проектов существуют и какова их эффективность?

Тема 11. Современные методы управления рисками финансового инвестирования

Вопросы и/или задания

1. Структура процентных ставок с учетом рисков.
2. Кривая доходностей.
3. Модели оценки цены и риска облигаций
4. Что такое риски финансового инвестирования и какова их роль в инвестиционной деятельности?
5. Какие современные методы управления рисками финансового инвестирования существуют и какова их эффективность?
6. Каковы основные принципы управления рисками финансового инвестирования и как они влияют на эффективность инвестиций?
7. Какие проблемы могут возникнуть при использовании современных методов управления рисками финансового инвестирования и как они решаются?

Тема 12. Управление рисками банкротства

Вопросы и/или задания

1. Причины возникновения состояния банкротства.
2. Объективные причины возникновения банкротства.
3. Субъективные причины возникновения банкротства.
4. Что такое риски банкротства и какова их роль в финансовой деятельности компаний?
5. Какие методы управления рисками банкротства существуют и какова их эффективность?
6. Каковы основные принципы управления рисками банкротства и как они влияют на финансовую устойчивость компаний?
7. Какие проблемы могут возникнуть при управлении рисками банкротства и как они решаются?

Раздел 5. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Наряду с чтением лекций и проведением практических занятий неотъемлемым элементом учебного процесса является *самостоятельная работа.* При самостоятельной работе достигается конкретное усвоение учебного материала, развиваются теоретические способности, столь важные для успешной подготовки и защиты выпускной работы бакалавра. Формы самостоятельной работы, обучаемых могут быть разнообразными. Самостоятельная работа включает: изучение литературы, веб-ресурсов, оценку, обсуждение и рецензирование публикуемых статей; ответы на контрольные вопросы; решение задач; самотестирование. Выполнение всех видов самостоятельной работы увязывается с изучением конкретных тем.

Типовые задания для самостоятельной работы и примерная тематика курсовых работ (проектов), предусмотренных учебным планом, представлены в фонде оценочных средств по дисциплине.

Раздел 6. Оценочные и методические материалы по образовательной программе (фонд оценочных средств) для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

В процессе освоения учебной дисциплины для оценивания сформированности требуемых компетенций используются оценочные материалы (фонды оценочных средств).

Типовые тестовые задания, типовые практические задания, типовые задания для контрольных работ, материалы для оценки результатов промежуточной аттестации и материалы для диагностической работы представлены в фонде оценочных средств по дисциплине.

Методические материалы, определяющие процедуру оценивания сформированных компетенций в соответствии с ООП

Качество знаний характеризуется способностью обучающегося точно, структурированно и уместно воспроизводить информацию, полученную в процессе освоения дисциплины, в том виде, в котором она была изложена в учебном издании или преподавателем.

Умения, как правило, формируются на занятиях семинарского типа. Задания, направленные на оценку умений, в значительной степени требуют от обучающегося проявления стереотипности мышления, т.е. способности выполнить работу по образцам, с которыми он работал в процессе обучения. Преподаватель же оценивает своевременность и правильность выполнения задания.

Навыки можно трактовать как автоматизированные умения, развитые и закрепленные осознанным самостоятельным трудом. Навыки формируются при самостоятельном выполнении обучающимися практико-ориентированных заданий, моделирующих решение им производственных и социокультурных задач в соответствующей области

профессиональной деятельности, как правило, при выполнении домашних заданий, курсовых проектов (работ), научно-исследовательских работ, прохождении практик, при работе индивидуально или в составе группы и т.д.

Устный опрос – это процедура, организованная как специальная беседа преподавателя с группой обучающихся (фронтальный опрос) или с отдельными обучающимися (индивидуальный опрос) с целью оценки сформированности у них основных понятий и усвоения учебного материала. Устный опрос может использоваться как вид контроля и метод оценивания формируемых компетенций (как и качества их формирования) в рамках самых разных форм контроля, таких как: собеседование, коллоквиум, зачет, экзамен по дисциплине. Устный опрос (УО) позволяет оценить знания и кругозор обучающегося, умение логически построить ответ, владение монологической речью и иные коммуникативные навыки. УО обладает большими возможностями воспитательного воздействия преподавателя. Воспитательная функция УО имеет ряд важных аспектов: профессионально-этический и нравственный аспекты, дидактический (систематизация материала при ответе, лучшее запоминание материала при интеллектуальной концентрации), эмоциональный (радость от успешного прохождения собеседования) и др. Обучающая функция УО состоит в выявлении деталей, которые по каким-то причинам оказались недостаточно осмысленными в ходе учебных занятий и при подготовке к зачёту или экзамену. УО обладает также мотивирующей функцией: правильно организованные собеседование, коллоквиум, зачёт и экзамен могут стимулировать учебную деятельность студента, его участие в научной работе.

Тесты являются простейшей формой контроля, направленной на проверку владения терминологическим аппаратом, современными информационными технологиями и конкретными знаниями в области фундаментальных и прикладных дисциплин. Тест может предоставлять возможность выбора из перечня ответов (один или несколько правильных ответов).

Семинарские занятия. Основное назначение семинарских занятий по дисциплине – обеспечить глубокое усвоение обучающимися материалов лекций, прививать навыки самостоятельной работы с литературой, воспитывать умение находить оптимальные решения в условиях изменяющихся отношений, формировать современное профессиональное мышление обучающихся. На семинарских занятиях преподаватель проверяет выполнение самостоятельных заданий и качество усвоения знаний, умений, определяет уровень сформированности компетенций.

Раздел 7. Методические указания для обучающихся по основанию дисциплины

Освоение обучающимся учебной дисциплины предполагает изучение материалов дисциплины на аудиторных занятиях и в ходе самостоятельной работы. Аудиторные занятия проходят в форме лекций, семинаров и практических занятий. Самостоятельная работа включает разнообразный комплекс видов и форм работы обучающихся.

Для успешного освоения учебной дисциплины и достижения поставленных целей необходимо внимательно ознакомиться с настоящей рабочей программы учебной дисциплины. Следует обратить внимание на список основной и дополнительной литературы, которая имеется в электронной библиотечной системе Университета. Эта информация необходима для самостоятельной работы обучающегося.

При подготовке к аудиторным занятиям необходимо помнить особенности каждой формы его проведения.

Подготовка к учебному занятию лекционного типа. С целью обеспечения успешного обучения обучающийся должен готовиться к лекции, поскольку она является важнейшей формой организации учебного процесса, поскольку: знакомит с новым учебным материалом; разъясняет учебные элементы, трудные для понимания; систематизирует учебный материал; ориентирует в учебном процессе.

С этой целью: внимательно прочитайте материал предыдущей лекции; ознакомьтесь с учебным материалом по учебнику и учебным пособиям с темой прочитанной лекции;

внесите дополнения к полученным ранее знаниям по теме лекции на полях лекционной тетради; запишите возможные вопросы, которые вы зададите лектору на лекции по материалу изученной лекции; постарайтесь уяснить место изучаемой темы в своей подготовке; узнайте тему предстоящей лекции (по тематическому плану, по информации лектора) и запишите информацию, которой вы владеете по данному вопросу

Предварительная подготовка к учебному занятию семинарского типа заключается в изучении теоретического материала в отведенное для самостоятельной работы время, ознакомление с инструктивными материалами с целью осознания задач занятия.

Самостоятельная работа. 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.

Подготовка к зачету, экзамену. К зачету, экзамену необходимо готовится целенаправленно, регулярно, систематически и с первых дней обучения по данной дисциплине. Попытки освоить учебную дисциплину в период зачетно-экзаменационной сессии, как правило, приносят не слишком удовлетворительные результаты. При подготовке к зачету обратите внимание на защиту практических заданий на основе теоретического материала. При подготовке к экзамену по теоретической части выделите в вопросе главное, существенное (понятия, признаки, классификации и пр.), приведите примеры, иллюстрирующие теоретические положения

Раздел 8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

Основная литература

1. Панягина А.Е. Управление рисками на предприятии: теория и практика: учебное пособие / Панягина А.Е., Свистунов А.В. — Москва: Ай Пи Ар Медиа, 2020. — 284 с. — ISBN 978-5-4497-0608-9. — Текст: электронный // IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/96561.html

2. Черняева С.Н. Управление рисками. Практикум: учебное пособие / Черняева С.Н., Коробова Л.А., Толстова И.С.. — Воронеж: Воронежский государственный университет инженерных технологий, 2022. — 91 с. — ISBN 978-5-00032-574-2. — Текст: электронный // IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/122601.html

Дополнительная литература

1. Управление рисками в компании: учебник для магистратуры / Д. Эрнст, Й. Хэкер, А. В. Затевахина [и др.]; Печеркина пер. — Москва: Прометей, 2024. — 296 с. — ISBN 978-5-00172-542-8. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/153456.html

2. Балабин А.А. Управление рисками: учебное пособие / Балабин А.А. — Новосибирск: Новосибирский государственный технический университет, 2022. — 128 с. — ISBN 978-5-7782-4850-2. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/155897.html

8.1. Требования к материально-техническому и учебно-методическому обеспечению программы бакалавриата

8.1.1. Университет располагает материально-технической базой, соответствующей действующим противопожарным правилам и нормам и обеспечивающей проведение всех видов дисциплинарной и междисциплинарной подготовки, практической и научно-исследовательской работ обучающихся, предусмотренных учебным планом.

Помещения представляют собой учебные аудитории для проведения учебных занятий, предусмотренных программой бакалавриата, оснащенные оборудованием и техническими средствами обучения, состав которых определяется в рабочих программах дисциплин (модулей).

В Университете имеются специализированные аудитории для проведения занятий по информационным технологиям.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде Университета.

Электронная информационно-образовательная среда Университета включает:

1. Официальный сайт Университета (https://www.iile.ru/)
2. Электронная информационно-образовательная среда «1С: Университет» договор от 10.09.2018 г. №ПРКТ-18281 (бессрочно)
3. Программы для ЭВМ. Система дистанционного обучения «Mirapolis» - Лицензионный договор №107/06/24-к от 27.06.2024 (Спецификация к Лицензионному договору №107/06/24-к от 27.06.2024, срок действия с 01.07.2026 по 30.06.2027 г.) https://impe.lms.mirapolis.ru/mira/
4. Программа для ЭВМ. Виртуальная комната «Mirapolis» - Лицензионный договор №107/06/24-к от 27.06.2024 (Спецификация к Лицензионному договору №107/06/24-к от 27.06.2024, срок действия с 01.07.2026 по 30.06.2027 г.) https://impe.lms.mirapolis.ru/mira/
5. Система тестирования INDIGO лицензионное соглашение (Договор от 07.11.2018 г. №Д-54792, бессрочно) http://212.48.35.211:85/

8.1.2. Университет обеспечен необходимым комплектом лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства (состав определяется в рабочих программах дисциплин (модулей) и подлежит обновлению при необходимости).

Перечень лицензионного программного обеспечения, в том числе отечественного производства:

1. Операционная система «Атлант» - Atlant Academ от 24.01.2024 г. (бессрочно)
2. Антивирусное программное обеспечение Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – Расширенный Russian Edition договор-оферта № Tr000941765 от 16.10.2025 г.

8.1.3. Обучающимся обеспечен доступ (удаленный доступ) к современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам, состав которых определяется в рабочих программах дисциплин (модулей) и обновляется при необходимости, но не реже одного раз в год.

Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

1. Информационно-поисковая система «Консультант Плюс» - Договор №МИ-ВИП-79717-56/2022 (бессрочно)
2. Электронно-библиотечная система IPRsmart лицензионный договор от 01.09.2024 г. №11652/24С (срок действия до 31.08.2027 г.) https://www.iprbookshop.ru/
3. Научная электронная библиотека eLIBRARY лицензионный договор SCIENC INDEX № SIO -3079/2026 от 30.01.2026 г. (срок действия до 29.01.2027г.) https://elibrary.ru

8.1.4. Обучающиеся из числа инвалидов и лиц с ОВЗ обеспечены электронными образовательными ресурсами в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья.

Раздел 9. Материально-техническое обеспечение образовательного процесса

Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации	Оборудование: специализированная мебель (мебель аудиторная (столы, стулья, доска аудиторная навесная), стол преподавателя, стул преподавателя. Технические средства обучения: персональный компьютер; мультимедийное оборудование (проектор, экран).
Помещение для самостоятельной работы	Специализированная мебель (столы, стулья), персональные компьютеры с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду Университета