Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»

ДАЛЬНЕВОСТОЧНЫЙ ИНСТИТУТ УПРАВЛЕНИЯ - филиал РАНХиГС

УТВЕРЖДЕНО
И.о. директора

Электронная подпись

ПРОГРАММА МАГИСТРАТУРЫ
Финансовая экономика

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ, реализуемой без применения электронного (онлайн) курса

Б1.В.06 Управление финансовыми рисками
(индекс, наименование дисциплины)

38.04.08 Финансы и кредит
(код, наименование направления подготовки)

Финансовая экономика
(квалификация)

очная, заочная
(форма(ы) обучения)

Год набора - 2024

Хабаровск, 2024 г.

Автор-составитель:
кандидат экономических наук, доцент,
доцент кафедры экономики и цифровых технологий Ковалева М.В.

Изменения внесла:
к. э.н., доцентом, доцентом кафедры экономики и цифровых технологий
Осипова А.А.

Заведующий кафедрой экономики и цифровых технологий
к.э.н., доцент Поливаева О. Г.

РПД одобрена на заседании кафедры экономики и цифровых технологий. Протокол от 06.05.2024 г. № 9

СОДЕРЖАНИЕ

1	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы	4
2	Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы	4
3	Содержание и структура дисциплины	5
4	Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся	5
5	Оценочные материалы промежуточной аттестации по дисциплине	7
6	Методические материалы для освоения дисциплины	19
7	Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»	21
7.1	Основная литература	30
7.2	Дополнительная литература	30
7.3	Нормативные правовые документы и иная правовая информация	30
7.4	Интернет-ресурсы	30
7.5	Иные источники	30
8	Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы	31

1 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы

1.1 Дисциплина Б1.В.06 Управление финансовыми рисками обеспечивает овладение следующими компетенциями:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код компонента компетенции	Наименование компонента компетенции
ПКс-3	Способен выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками	ПКс-3.2	Способен разрабатывать систему управления финансово-экономическими рисками деятельности хозяйствующего субъекта

1.2. В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

Профессиональные действия	Код компонента компетенции	Результаты обучения
Код С Построение интегрированной системы управления рисками организации Специалист по управлению рисками[1] С/01.7 Планирование, координирование и нормативное обеспечение интегрированной комплексной деятельности подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации С/04.7 Разработка интегрированной системы управления рисками С/05.7 Внедрение интегрированной системы управления рисками С/06.7 Эксплуатация интегрированной системы управления рисками	ПКс-3.2	на уровне знаний: - знает методологию управления рисками хозяйствующих субъектов; классификационные признаки финансовых рисков
		на уровне умений: - умеет идентифицировать финансовые риски в деятельности субъектов хозяйствования; - оценивать количественные и качественные показатели финансовых рисков проекта для проведения исследования по вопросам функционирования и контроля системы риск-менеджмента

[1] Специалист по управлению рисками. № 564н 30.08. 2018г.

2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО

Объем дисциплины: общая трудоемкость дисциплины Б1.В.06 Управление финансовыми рисками 4 зачетных единицы, что составляет 144 акад.ч / 108астр.ч., из них:

- для очной формы обучения: количество академических часов, выделенных на контактную работу выделено 28 ак. ч./ 21 астр. ч. (8 ак. ч./ 6 астр. ч. лекционные занятия, - 20 ак. ч./ 15 астр. ч. практические занятия.), – 36 ак. ч./ 27 астр.ч. – контроль, 80 ак. ч./ 60 астр.ч. на самостоятельную работу обучающихся.

- для заочной формы обучения: количество академических часов, выделенных на контактную аудиторную работу с преподавателем: 8 ак.ч./ 6 астр.ч., лекционные занятия – 2 ак.ч./ 1,5 астр.ч., практические занятия - 6 ак.ч./ 4,5 астр.ч., контроль – 9 ак.ч./ 6,75 астр.ч., на самостоятельную работу обучающихся – 127 ак.ч./ 92,25 астр.ч.

Место дисциплины в структуре ОП ВО

Объем дисциплины: Дисциплина Б1.В.06 Управление финансовыми рисками входит в структуру программы подготовки магистратуры и относится к дисциплинам учебного плана в части, формируемой участниками образовательных отношений, изучается на 2 курсе в 4 семестре.

Форма промежуточной аттестации по дисциплине в соответствии с учебным планом - экзамен.

3. Содержание и структура дисциплины

3.1. Структура дисциплины

Очная форма обучения

№п\п	Наименование тем (разделов)	Объем дисциплины (модуля), час						Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточной аттестации**
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР/ЭО, ДОТ***	
			Л/ЭО, ДОТ	ЛР/ЭО, ДОТ	ПЗ/ЭО, ДОТ	КСР		
1	Финансовый риск как экономическая категория, его сущность и области проявления	13	1	-	2		10	О
2	Идентификация рисков. Состав и содержание этапов оценки риска.	13	1	-	2		10	СЗ
3	Методология исследования финансовых рисков инвестиционного проекта	13	1	-	2		10	О
4	Система количественных оценок экономического риска и портфель ценных бумаг	13	1	-	2		10	Т, РЗ
5	Практические инструменты прогнозирования финансово-экономических рисков	13	1	-	2		10	Т, ОК

6	Проектирование системы управления рисками.	13	1	-	2		10	О
7	Учет риска при принятии финансовых управленческих решений.	15	1	-	4		10	О
8	Система превентивных мероприятий, направленных на снижение финансового риска.	15	1	-	4		10	О
	Промежуточная аттестация					**36**		**Экзамен**
	Всего:	**144**	**8**	**-**	**20**	**36**	**80**	

Используемые сокращения:
Л - занятия лекционного типа (лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся);
ЛР - лабораторные работы (вид занятий семинарского типа;
ПЗ - практические занятия (виды занятий семинарского типа за исключением лабораторных работ);
КСР - индивидуальная работа обучающихся с педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях (в том числе индивидуальные консультации);
ДОТ -занятия, проводимые с применением дистанционных образовательных технологий, в том числе с применением виртуальных аналогов профессиональной деятельности.
СРО - самостоятельная работа, осуществляемая без участия педагогических работников организации и (или) лиц, привлекаемых организацией к реализации образовательных программ на иных условиях.
* формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), тестирование (Т),, расчетные задания (РЗ), ситуационные задания (СЗ),опорный конспект (ОК).
** форма промежуточной аттестации: экзамен.

Заочная форма обучения

№п\п	**Наименование тем (разделов)**	**Объем дисциплины (модуля), час**						**Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточной аттестации****
		Всего	**Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий**				**СР/ ЭО, ДОТ *****	
			Л/ЭО, ДОТ	**ЛР/ ЭО, ДОТ**	**ПЗ/ ЭО, ДОТ**	**КСР**		
1	Финансовый риск как экономическая категория, его сущность и области проявления	18	0,5	-	0,5	2	15	О
2	Идентификация рисков. Состав и содержание этапов оценки риска.	17,5	-	-	0,5	2	15	СЗ
3	Методология исследования финансовых рисков инвестиционного проекта	17,5	0,5	-	1	1	15	О
4	Система количественных оценок экономического риска и портфель ценных бумаг	17	-	-	1	1	15	Т, РЗ
5	Практические инструменты прогнозирования финансово-экономических рисков	17,5	0,5	-	1	1	15	Т, ОК
6	Проектирование системы управления рисками.	17	-	-	1	1	15	О
7	Учет риска при принятии финансовых управленческих решений.	17	0,5	-	0,5	1	15	О

8	Система превентивных мероприятий, направленных на снижение финансового риска.	22,5	-	-	0,5	-	22	О
	Промежуточная аттестация	**9**				**9**		**Экзамен**
	Всего:	**144**	**2**	**-**	**6**	**9**	**127**	

Используемые сокращения:
Л - занятия лекционного типа (лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся);
ЛР - лабораторные работы (вид занятий семинарского типа;
ПЗ - практические занятия (виды занятий семинарского типа за исключением лабораторных работ);
КСР - индивидуальная работа обучающихся с педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях (в том числе индивидуальные консультации);
ДОТ -занятия, проводимые с применением дистанционных образовательных технологий, в том числе с применением виртуальных аналогов профессиональной деятельности.
СРО - самостоятельная работа, осуществляемая без участия педагогических работников организации и (или) лиц, привлекаемых организацией к реализации образовательных программ на иных условиях.
* формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), тестирование (Т),, расчетные задания (РЗ), ситуационные задания (СЗ),опорный конспект (ОК).
** форма промежуточной аттестации: экзамен.

3.2. Содержание дисциплины

Тема 1. Финансовый риск как экономическая категория, его сущность и области проявления

Экономическое содержание категории «риск». Сущность предпринимательского риска. Разновидности ситуации риска, противоречия рисков. Сущность и формы проявления защитной функции риска. Экономические пределы риска. Понятия интереса (процентной ставки), дисконта и дисконт – фактора. Кредитование, дисконтирование и оценка эффективной ставки финансовой сделки. Оценка облигаций с нулевым купоном. Оценка облигаций с фиксированной купонной ставкой. Оценка бессрочных облигаций с постоянным доходом. Оценка обыкновенных акций. Оценка акций с равномерно возрастающими дивидендами. Формула Гордона. Формула Модильяни.

Облигации, акции, векселя, государственные финансовые обязательства, опционы, фьючерсы, варранты .Действующие лица на фондовом рынке: эмитенты, инвесторы, посредники – брокерские конторы, фондовые биржи, инвестиционные фонды, банки, осуществляющие продвижение ценных бумаг от эмитентов к инвесторам..

Тема 2. Идентификация рисков. Состав и содержание этапов оценки риска

Характеристика рисков в различных сферах предпринимательской деятельности. Определение объекта анализа риска. Формирование анкет идентификации рисков. Производственно-финансовые риски предприятия. Страновой риск и методы его измерения. Риск инновационной деятельности.

Тема 3. Методология исследования финансовых рисков инвестиционного проекта

Систематизация инструментария оценки рисков. Планирование эксперимента в риск-анализе. Эксперименты: регрессионные, факторные, экстремальные, отсеивающие, дискриминирующие. Методика применения факторного эксперимента к риск-анализу.

Диверсификация инвестиций в управлении рисками и портфелями ценных бумаг и проектов. Простая диверсификация инвестиционного портфеля. Учет индивидуальных предпочтений к рискам конкретных инвесторов. Индивидуальные предпочтения между доходностью и риском в управлении инвестиционным портфелем. Основы теории полезности в учете индивидуальных предпочтений к рискам. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта: вероятностный подход к оценке риска инвестиционного проекта; мультисценарный подход к оценке риска; чувствительность показателей эффективности инвестиционного проекта к параметрам; оценка вероятности окупаемости инвестиционного проекта; оценка риска от внезапного падения доходов. Основные функции Excel и программы Project 6.0 для оценки эффективности и управления рисками инвестиционного проекта.

Понятия финансового риска. Количественная оценка доходности и риска ценной бумаги как математическое ожидание и дисперсии эффективности ценной бумаги. Пример использования неравенства Чебышева для оценки вероятности разорения инвестора. Хеджирование

Тема 4. Система количественных оценок риска и портфель ценных бумаг.

Общие методические аспекты количественной оценки риска. Количественные оценки риска и методы их определения. Шкалы риска и характеристика их градаций. Специфические показатели, используемые для количественной оценки риска. Экономико-математические модели оценки и управления рисками:

- модель оценки эффективности проекта с учетом антирисковых мероприятий;
- модель оптимизации интегральных рисковых затрат;
- модель оптимизации интегральных внешних и внутренних рисковых затрат.

Вероятностная имитационная модель оценки рисков. Схема реализации метода Монте-Карло в инвестиционных расчетах. Учет вероятностной зависимости риск-переменных. Графический анализ. Анализ количественных показателей.

Понятия финансового риска на фондовом рынке. Портфель ценных бумаг. Основные понятия. Ожидаемая доходность ценных бумаг. Ковариационная и корреляционная матрица для эффективностей ценных бумаг. Оценка дохода и риска портфеля ценных бумаг. Оценка риска портфеля из независимых ценных бумаг. Диверсификация портфеля. Оценка риска портфеля из коррелированных ценных бумаг. Оценка риска портфеля из антикоррелированных ценных бумаг.

Постановка задачи оптимального управления портфелем ценных бумаг. Задача Г. Марковица (H. Markowitz) оптимизации портфеля ценных бумаг. Аналитическое решение задачи для случая, когда нет ограничений в виде неравенств. Численные методы решения задач оптимизации в общем случае. Программные средства для решения задачи оптимизации портфеля ценных бумаг.

Постановка задачи оптимального управления портфелем ценных бумаг. Задача Д. Тобина (J. Tobin) оптимизации портфеля инвестора в случае, когда ценные бумаги разбиты на две группы: безрисковых и рискованных ценных бумаг. Аналитическое и численное решение задачи. Программные средства для решения задачи оптимизации. Понятие бета вклада j-ой ценной бумаги относительно оптимального портфеля. Примеры расчета коэффициентов Шарпа У.Ф. (Sharpe W.F.)

Тема 5. Практические инструменты прогнозирования финансово-экономических рисков

Экспертные процедуры и методы субъективных оценок при измерении риска. Характеристика экспертных процедур. Общая схема экспертизы: подбор экспертов и формирование экспертных групп; формирование вопросов и составление анкет; работа с экспертами; анализ и обработка экспертных оценок. Роза рисков. Спираль рисков. Метод Дельфи. Метод аналогий. Метод ставки процента (дисконта) с поправкой на риск. Модель ценообразования на рынке капитальных вложений CAPM. Метод критических значений. Построение сложных распределений вероятностей (дерево решений). Методы оценки рисков при составлении плана финансирования инвестиционного проекта. Оценка кредитного риска. Компьютерный инструментарий риск-анализа. Статистика финансового рынка. Прямой метод расчета статистических характеристик ценных бумаг. Индекс Доу-Джонса. Метод ведущего фактора для расчета статистических характеристик ценных бумаг. Равновесие на конкурентном финансовом рынке. Цены равновесия на идеальном рынке. Понятие бета вклада j-ой ценной бумаги относительно оптимального портфеля. Примеры расчета коэффициентов Шарпа У.Ф. (Sharpe W.F.)

Функции посреднических структур на финансовом рынке. Традиционный фундаментальный анализ. Традиционный технический анализ фондового рынка. Метод наименьших квадратов. Современный технический анализ фондового рынка. Стиль и тактика менеджмента. Эффективность работы менеджера и аналитика.

Тема 6. Проектирование системы управления рисками

Цели и задачи управления рисками. Основные принципы разработки программы управления рисками. Этапы процесса управления рисками. Процедуры управления риском. Выбор методов управления рисками и их характеристика, классификация. Методы снижения последствий рисков.

Управление рисками инвестиционного проекта. Анализ чувствительности проекта. Качественный подход к анализу рисков инвестиционного проекта. Риск-менеджер – импровизатор и системный организатор, его функции. Системная организация работ по управлению рисками.

Тема 7. Учет риска при принятии управленческих решений

Принятие решений в условиях риска и неопределенности. Модель теории принятия решений. Принципы доминирования. Математическое ожидание и дисперсия. Принцип Бернулли: определение функций полезности. Сравнительная оценка вариантов решений с учетом риска. Способы учета влияния неопределенности на эффективность инвестиционных проектов. Риски инвестирования в организацию оценки имущественных комплексов. Функции полезности и их оценка. Выделение рисков при принятии управленческих решений. Виды отношений к риску. Метод корректировки. Жесткое планирование. Гибкое

планирование при принятии инвестиционных решений. Оценка рисковых инвестиций, ориентированная на рынок. Модель финансовых активов (CAPM).

Тема 8. Система превентивных мероприятий, направленных на снижение экономического риска

Организация работ по управлению рисками. Стадии разработки ПУР (программы управления рисками) – предварительная и основная. Стратегия фирмы по управлению рисками и выбор процедур управления ими. Оценка эффективности ПУР. Контроль и пересмотр ПУР. Анализ рисков и формирование плана превентивных мероприятий. Критерии оценки и их анализ. Алгоритм оценки мероприятий по снижению рисков. Снижение рисков бизнеса с использованием теории опционов: опционы, фьючерсы, реальные опционы, статическое и динамическое хеджирование опционами. Управление инвестиционными рисками на основе модели «подверженной риску стоимости».

4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся

4.1 В ходе реализации дисциплины Б1.В.05 Управление финансовыми рисками используются следующие методы **текущего контроля успеваемости обучающихся** :

Тема (раздел)	Методы текущего контроля успеваемости	
Финансовый риск как экономическая категория, его сущность и области проявления	О	Р
Идентификация рисков. Состав и содержание этапов оценки риска.	СЗ	
Методология исследования финансовых рисков инвестиционного проекта	О	
Система количественных оценок экономического риска и портфель ценных бумаг	РЗ, Т	
Практические инструменты прогнозирования финансово-экономических рисков	Т, РЗ	
Проектирование системы управления рисками.	Т, ОК	
Учет риска при принятии финансовых управленческих решений.	О	
Система превентивных мероприятий, направленных на снижение финансового риска.	О	

Примечание:

** формы текущего контроля успеваемости: опрос (О),опорный конспект для обучающихся заочной формы обучения (ОК), тестирование (Т), реферат (Р).*

4.2 Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся

Типовые вопросы к опросу/для подготовки опорного конспекта:

Типовые оценочные материалы по теме 1 «Финансовый риск как экономическая категория, его сущность и области проявления»

1. Подходы к определению категории «финансовый риск».
2. Признаки классификации финансовых рисков.
3. Дискуссии о функциях риска
4. Звенья в управлении рисками.

Типовые оценочные материалы по теме 2 «Идентификация рисков. Состав и

содержание этапов оценки риска.»

Типовые темы эссе

Обучающийся самостоятельно выбирает тему, по которой будет выполнено эссе.

1. Инструменты реализации стратегии управления рисками в организации
2. Инструменты реализации финансовой стратегии по управлению рисками
3. Инструменты реализации инвестиционной политики РФ.

Типовые оценочные материалы по теме 3 «Методология исследования финансовых рисков инвестиционного проекта»

1.Систематизация инструментария оценки рисков.

Планирование эксперимента в риск-анализе.

Эксперименты: регрессионные, факторные, экстремальные, отсеивающие, дискриминирующие.

Методика применения факторного эксперимента к риск-анализу.

Обучающийся составляет опорный конспект по теме.

Типовые оценочные материалы по теме 4 «Система количественных оценок экономического риска и портфель ценных бумаг»

1 Типовые ситуационные задания: Индивидуальная работа студентов.

Индивидуальная работа студента осуществляется в процессе решения рисковых ситуаций, для чего в ходе изучения курса каждому студенту выдается индивидуальное задание для выполнения работ аналитического характера.

Охарактеризовать финансовые риски субъектов хозяйствования, составить классификацию финансовых рисков, указать возможные методы снижения последствий рисков по отраслям экономики в Хабаровском крае за трехлетний период и оценить ситуацию. Составить программу управления рисками (с учетом прогноза) до 2024 г., с использованием материалов Госкомстата РФ и Хабаровского края, в частности. Исходные данные приведены в табл.

Таблица

№ варианта	Отрасль
1.	Электроэнергетика
2.	Топливная промышленность
3.	Транспорт
4.	Связь
5.	Машиностроение и металлообработка
6.	Сельское хозяйство
7.	Рыбная промышленность
8.	Пищевая промышленность
9.	Лесная, деревообрабатывающая промышленность
10.	Строительство

Типовые оценочные материалы по теме 5 «Практические инструменты прогнозирования финансово-экономических рисков»

Типовое задание Примерные тесты для проведения входного контроля

Вариант I. 1. Как понимать содержание категории «риск»?

2.Какие виды финансовых рисков Вам известны?

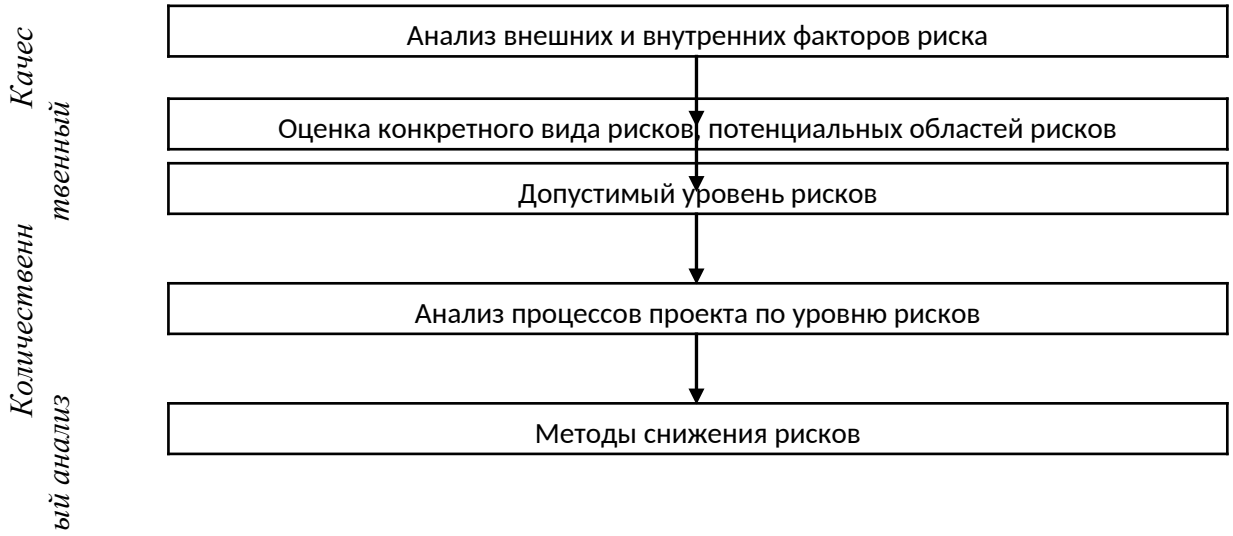
Вариант II. 1. Что Вы понимаете под «управлением риском» ?
2. Какими показателями характеризуется эффективность ПУР?

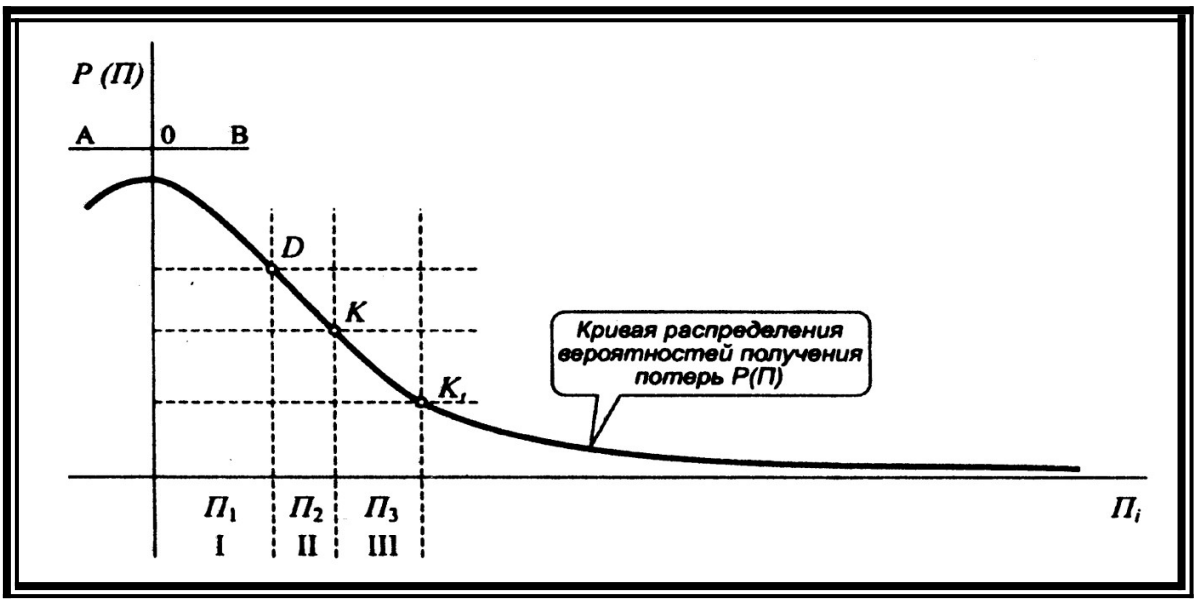
Вариант III. **1**. Что Вы понимаете под «идентификацией рисков»?
2. Какими показателями измеряется масштаб финансовых рисков?
Типовые расчетные задания: Заполнить опросный лист
ОПРОСНЫЕ ЛИСТЫ

Термин	Содержание
Финансовые риски Инвестиционные риски Коммерческие риски Премия за риск Нормативные документы, регулирующие страхование рисков в РФ Минимизация рисков проекта Классификация возможных убытков Процедуры и методы оценки финансовых рисков Специфические показатели, используемые для количественной оценки рисков Идентификация финансовых рисков Качественный подход к анализу финансовых рисков Имитационное моделирование в количественном анализе рисков Схема реализации метода Монте-Карло Практические инструменты риск-анализа Методы экспертных оценок Роза финансовых рисков. Метод Дельфи. Спираль рисков. Метод ставки процента (дисконта) с поправкой на риск в инвестиционных расчетах. Модель ценообразования на рынке капитальных вложений САРМ. Компьютерный инструментарий оценки проектных рисков. Управление финансовыми рисками Методы снижения последствий финансовых рисков ПУР	

Типовые оценочные материалы по теме 6 **«Проектирование системы управления рисками»**

Типовое задание
Ответить на вопрос : что изображено на рисунке
Алгоритм анализа рисков или классификация рисков





Показатели рисков и их допустимого уровня (распределения вероятностей потерь и допустимых уровней рисков)

Типовые оценочные материалы по теме 7 «Учет риска при принятии финансовых управленческих решений.»

Типовые вопросы для опроса:

1. Причины образования рисков
2. Отличительные особенности финансовых рисков
3. Виды финансовых рисков
4. Характеристика финансовых решений с учетом фактора риска

Типовые оценочные материалы по теме 8 Система превентивных мероприятий, направленных на снижение финансового риска.

Типовые вопросы для опроса:

1. Причины возникновения рискообразующих факторов
2. Формы превентивных мероприятий
3. Виды превенитивынх мероприятий и оценка их эффективности
4. Цели и задачи управления рисками
5. Методы управления рисками

Типовые задания для проведения «круглого стола»

По теме 8 предполагается проведение круглого стола, на котором происходит обсуждение основных направлений разработки системы риск-менеджмента

Обучающимся необходимо подготовить мини-доклады и презентации к ним по направлениям:

1. Вероятностная модель оценки рисков и управления финансовыми рисками.
2. Управление рисками инвестиционного проекта.
3. Методы снижения последствий финансовых рисков.
4. Принятие решений в условиях финансового риска.
5. Разработка программы управления рисками на предприятии (ПУР).
6. Информационное сопровождение предварительной и основной стадий разработки и пересмотра ПУР.
7. Оценка эффективности ПУР.
8. Формирование плана превентивных мероприятий.

Рекомендуемая тематика рефератов:

1. Принятие инвестиционных решений в условиях риска.
2. Управление инвестиционными рисками.
3. Методы измерения инвестиционного дохода и риска.
4. Практические инструменты риск-анализа.
5. Классификация рисков промышленного предприятия.
6. Программные продукты, используемые для оценки рисков.
7. Измерители интегральной рискованности бизнеса.
8. Применение методов оценки рисков при составлении плана финансирования инвестиционного проекта.
9. Классификация методов снижения последствий финансовых рисков.
10. Оценка рисков инвестирования в организацию оценки имущественных комплексов.
11. Формирование стратегии фирмы по управлению рисками и выбор процедур управления ими.
12. Оценка влияния рисков при формировании плана превентивных мероприятий. Критерии оценки и их анализ.
13. Алгоритм оценки мероприятий по снижению финансовых рисков.
14. Снижение рисков бизнеса с использованием теории опционов: опционы, фьючерсы, реальные опционы, статическое и динамическое хеджирование опционами.

Контрольные работы (задачи)

Примеры типовых задач

Задача 1

Осторожный инвестор формирует портфель из 3-х ценных бумаг. Средняя эффективность портфеля из 3-х ценных бумаг равна:

где xk – доля средств затраченных на k- ую ценную бумагу.

$$ms = 10x_1 + 15x_2 + 25x_3$$

$$V = x_1^2 + 2x_2^2 + 4x_3^2$$

Риск сделки, определенный как дисперсия ее эффективности, равен:

При этом предполагается, что выполнено условие баланса:

$x_1 + x_2 + x_3 = 1$

Найти структуру портфеля ценных бумаг x_1 , x_2 , x_3, обеспечивающую минимальный риск. Найти соответствующий минимальный риск и соответствующую ожидаемую доходность оптимального портфеля. Сравнить доходность и риск оптимального портфеля ценных бумаг со случаями:

- вложения всех средств в наиболее доходную;
- в наименее рискованную ценную бумагу;
- со случаем вложения всех средств равными порциями во все ценные бумаги.

Воспользоваться функциями Excel

Задача 2. (Задача Г. Марковица)

Инвестор формирует портфель из 3-х ценных бумаг. Средняя доходность портфеля из 3-х ценных бумаг равна:

где xk – доля средств затраченных на k- ую ценную бумагу.

$$m = 10x_1 + 15x_2 + 25x_3$$

Риск сделки, определенный как дисперсия ее эффективности, равен:

$$V = x_1^2 + 2x_2^2 + 4x_3^2$$

При этом предполагается, что выполнено условие баланса:

$x_1 + x_2 + x_3 = 1$

Найти структуру портфеля ценных бумаг x_1 , x_2 , x_3, обеспечивающую минимальный риск при фиксированной доходности портфеля m = 10, 15, 20, 25 и выполнении условие баланса. Найти соответствующий минимальный риск.

Для этого

Численными методами произвести расчет оптимального портфеля инвестора с помощью программы оптимизации Excel «Поиск решения». Рассмотреть несколько вариантов доходности портфеля. Определить риск оптимального портфеля инвестора

Определить структуру x_1, x_2, x_3 и риск $\sigma^2 = V$ оптимального портфеля инвестора для четырех значений доходности m = 10, 15, 20, 25. портфеля

Построить графики зависимости структуры x_1, x_2, x_3 и риска $\sigma^2 = V$ портфеля от доходности m = 10, 15, 20, 25. оптимального портфеля.

Рассмотреть случай, когда дополнительно используются ограничения в виде неравенств $x_1 \geq 0,\ x_2 \geq 0, x_3 \geq 0$. Определить риск и структуру оптимального портфеля.

Построить графики зависимости структуры x_1, x_2, x_3 и риска $\sigma^2 = V$ портфеля от доходности m оптимального портфеля для случая когда $x_1 \geq 0,\ x_2 \geq 0, x_3 \geq 0$.

На основании полученных результатов сделать выводы о свойствах оптимального портфеля в задаче Г.Марковица.

Задача 3 (Задача Д.Тобина (J. Tobin))

Инвестор формирует портфель из 4-х ценных бумаг, одна из которых является государственной безрисковой бумагой. Средняя эффективность портфеля из 4-х ценных бумаг равна:

где xk – доля средств затраченных на k- ую ценную бумагу, в частности x_0 средств затрачено на

$$ms = x_0 + 13x_1 + 21x_2 + 26x_3$$

безрисковую ценную бумагу.

Риск сделки, определенный как дисперсия эффективности, равен:

При этом предполагается, что выполнено условие баланса:

$$V = x_1^2 + 2x_2^2 + 4x_3^2$$

Найти структуру портфеля ценных бумаг, обеспечивающую минимальный риск при

$$x_0 + x_1 + x_2 + x_3 = 1$$

фиксированной доходности. Найти соответствующий минимальный риск.

Для этого

Построить аналитическое решение задачи Д.Тобина. Построить графики зависимости структуры x_0, x_1, x_2, x_3 и риска σ портфеля от желаемой (фиксированной) доходности m ($1<m<26$) оптимального портфеля.

Численными методами произвести расчет оптимального портфеля инвестора с помощью программы оптимизации Excel «Поиск решения ». Определить структуры x_0, x_1, x_2, x_3 и риска σ оптимального портфеля инвестора. Рассмотреть несколько вариантов доходности m ($1<m<26$) оптимального портфеля. Построить графики зависимости структуры x_0, x_1, x_2, x_3 и риска σ портфеля от желаемой (фиксированной) доходности m оптимального портфеля.

На основании полученных результатов сделать выводы о свойствах оптимального портфеля в задаче Д.Тобина.

Критерии оценивания результатов успеваемости при осуществлении текущего контроля

Критерии оценки расчетных задач, ситуационныхзаданий

70 баллов - обучающийся верно выполняет практическое задание, умеет правильно применять тот или иной инструмент при проведении анализа, может произвести адекватную оценку проблемной ситуации и сделать прогноз ее последствий, правильно решает ситуационную задачу, делая необходимые ссылки на нормативно-правовые акты и приводя возможные варианты последствий; ориентируется в налоговом законодательстве.

40 баллов - обучающийся выполняет практическое задание с незначительными ошибками; правильно применяет тот или иной инструмент при проведении анализа, однако, недостаточно точно производит оценку проблемной ситуации, допускает несущественные ошибки при прогнозировании последствий проблемной ситуации, правильно решает ситуационную задачу, делая необходимые ссылки на нормативно-правовые акты;ориентируется в налоговом законодательстве.

20 баллов - обучающийся выполняет практическое задание с существенными ошибками; выполняет практические расчеты в неполном объеме, испытывает трудности при выборе и применении инструментария проведения анализа; оценку проблемной ситуации производит с ошибками, которые после собеседования может исправить; не может осуществить прогноз последствий проблемной ситуации, при решении ситуационной задачи испытывает трудности в соотнесении теоретических знаний с практическими ситуациями; слабо ориентируется в налоговом законодательстве.

0 баллов - обучающийся не может выполнить практическое задание, произвести анализ; не может дать оценку проблемной ситуации, не способен осуществить прогноз последствий проблемной ситуации, решить ситуационную задачу, частично ориентируется в налоговом законодательстве.

Шкала оценивания результатов успеваемости при осуществлении текущего контроля

Вид оценочного средства	Шкала оценивания (баллы)
Расчётное задание	0-70
Итого	***0-70****

* 70 - максимальное количество баллов по результатам текущего контроля

Опрос/опорный конспект по теме оценивается по следующим критериям:

1 балл – обучающийся верно, самостоятельно отвечает на поставленный вопрос,

0 балл – обучающийся испытывает затруднения при ответе на поставленный вопрос или не может ответить на поставленный вопрос.

Тестирование оценивается в зависимости от количества верных ответов (в тесте 10 вопросов по каждому разделу):тестовое задание оценивается из расчета за каждый правильный ответ – 1 балл.

Рефераты оцениваются по следующим критериям*:*

Защита рефератов осуществляется, как правило, в форме групповой дискуссии, которая предполагает активное взаимодействие обучающегося с другими обучающимися группы и преподавателем. Дискуссия направлена на развитие коммуникативных навыков и формирования собственной позиции по рассматриваемой проблеме. Помимо содержания реферата преподавателем оценивается процедура его представления группе и аргументированность ответов на задаваемые выступающему вопросы.

25 баллов – реферат написан с соблюдением всех требований к письменным работам обучающихся, тема раскрыта полностью, верно определены объект и предмет исследования, представлен широкий перечень источников (не менее 10), проведен сравнительный анализ, использована действующая нормативная правовая база, приведены различные точки зрения, сделаны выводы, обучающийся доступно с использованием профессиональной терминологии, без существенной опоры на текст сделал доклад по теме реферата, обучающийся дал полные и развернутые ответы на вопросы группы и преподавателя, сформировал и отстаивает собственную позицию по рассматриваемой проблеме;

20 баллов – реферат написан с соблюдением всех требований к письменным работам обучающихся, тема раскрыта полностью, представлен широкий перечень источников (не менее 10), использована действующая нормативная правовая база, сравнительный анализ и выводы не представлены, обучающийся доступно, но с существенной опорой на текст, с использованием профессиональной терминологии сделал доклад по теме реферата, обучающийся дал достаточно полные ответы на вопросы группы и преподавателя, сформировал собственную позицию по рассматриваемой проблеме;

10 баллов – реферат написан с соблюдением всех требований к письменным работам обучающихся, тема раскрыта не полностью, объект и предмет исследования определены неверно, обучающийся доступно, но с существенной опорой на текст, с частичным использованием профессиональной терминологии представил доклад по теме реферата, обучающийся дал ответы не на все вопросы группы и преподавателя, не сформировал собственную позицию по рассматриваемой проблеме;

0 баллов – тема не раскрыта, неверно определены объект и предмет исследования, список использованных источников недостаточный, отсутствует сравнительный анализ, не сделаны выводы, обучающийся с существенной опорой на текст, без использования профессиональной терминологии представил доклад по теме, обучающийся не ответил на вопросы группы и преподавателя, не сформировал какую-либо позицию по рассматриваемой проблеме.

Шкала оценивания результатов успеваемости при осуществлении текущего контроля

Вид оценочного средства	Шкала оценивания (баллы)
Опрос/опорный конспект	0-25
Тестирование	0-20
Реферат	0-25
Итого	***0-70****

*70 - максимальное количество баллов по результатам текущего контроля

5. Оценочные материалы промежуточной аттестации по дисциплине

5.1 Экзамен проводится с применением следующих методов (средств): собеседование по вопросам. Экзамен принимает лектор в рамках индивидуального собеседования по типовым вопросам. Процедура проведения зачета установлена в соответствии с Регламентом по проведению промежуточной аттестации с применением балльно-рейтинговой системы оценки знаний, обучающихся в Дальневосточном институте управления – филиале РАНХиГС.

5.2 Оценочные материалы промежуточной аттестации

Компонент	**Промежуточный/ключевой индикатор**	**Критерий оценивания**

компетенции	оценивания	
ПКс-3.2	разрабатывает систему управления финансов-экономическими рисками деятельности хозяйствующего субъекта	Обучающийся демонстрирует: уверенное понимание основ оценки финансовых рисков, инструментальных методов управления ими, умение оценивать ресурсы в ситуации риска, осуществлять расчет и анализ показателей рисковых ограничений, используя математический аппарат, нести ответственность за экономическую эффективность в ситуациях финансового риска;

Типовые оценочные материалы промежуточной аттестации

Вопросы к контрольной работе на экзамене

1. Понятие финансово-экономических рисков.
2. Области проявления финансово-экономических рисков.
3. Методы оценки финансово-экономических рисков.
4. Методические принципы прогнозирования финансово-экономических рисков.
5. Экономическая сущность инвестиций.
6. Понятие инвестиционного проекта.
7. Товары финансового рынка.
8. Фондовый рынок.
9. Первичные ценные бумаги.
10. Вторичные ценные бумаги.
11. Действующие лица фондового рынка.
12. Финансовые вычисления. Понятия интереса (процентной ставки), дисконта и дисконт – фактора.
13. Расчет кредитования по схеме простых процентов.
14. Расчет кредитования по схеме сложных процентов.
15. Сравнение кредитования по схеме простых и сложных процентов.
16. Расчет кредитования по схеме смешанных (комбинированных) процентов.
17. Расчет дисконтирования по схеме простых процентов.
18. Расчет дисконтирования по схеме сложных процентов. Дисконт – фактор.
19. Эффективная ставка финансовой сделки.
20. Непрерывная ставка (сила роста).
21. Непрерывный дисконт.
22. Однонаправленные потоки платежей. Основные понятия и связи между ними.
23. Финансовая рента (аннуитет) постнумерандо.
24. Финансовая рента (аннуитет) пренумерандо.
25. Расчет финансовой ренты (аннуитета) по непрерывной схеме.
26. Двусторонние потоки платежей. Основные понятия и связи между ними.
27. Эффективная ставка потока платежей.
28. Эффективная ставка кредита.
29. Сравнение аннуитетной (равными платежами) и дифференцированной схемы погашения кредита. Парадокс эффективной процентной ставки кредита.
30. Учет вероятностных характеристик потоков платежей
31. Финансовые вычисления по ценным бумагам. Оценка облигаций с нулевым купоном.

32. Оценка облигаций с фиксированной купонной ставкой.
33. Оценка бессрочных облигаций с постоянным доходом.
34. Оценка обыкновенных акций.
35. Оценка акций с равномерно возрастающими дивидендами. Формула Гордона.
36. Формула Модильяни для оценки акций.
37. Инвестиции. Виды инвестиций.
38. Критерии оценки эффективности инвестиционных проектов: чистое современное значение NPV, эффективная ставка (внутренняя эффективность) IRR, срок окупаемости Pb , норма (индекс) рентабельности инвестиционного проекта H.
39. Финансовый риск. Основные понятия.
40. Использование неравенства Чебышева для оценки рискованности финансовой операции.
41. Хеджирование.
42. Портфель ценных бумаг. Основные понятия.
43. Оценка риска портфеля ценных бумаг.
44. Оценка риска портфеля из независимых ценных бумаг. Диверсификация портфеля.
45. Оценка риска портфеля из коррелированных ценных бумаг.
46. Оценка риска портфеля из антикоррелированных ценных бумаг.
47. Построение оптимального портфеля ценных бумаг при рискованных вложениях. Задача Г.Марковица.
48. Построение оптимального портфеля ценных бумаг при рискованных и безрисковых вложениях. Задача Д.Тобина.
49. Методы расчета премии за опцион.
50. Статистика финансового рынка.
51. Прямой метод расчета статистических характеристик ценных бумаг. Индекс Доу-Джонса.
52. Метод ведущего фактора для расчета статистических характеристик ценных бумаг.
53. Равновесие на конкурентном финансовом рынке.
54. Цены равновесия на идеальном рынке.
55. Стратегия и тактика инвестиционного менеджмента.
56. Функции посреднических структур на финансовом рынке.
57. Традиционный фундаментальный анализ.
58. Традиционный технический анализ фондового рынка.
59. Современный технический анализ фондового рынка.
60. Стиль и тактика менеджмента. Эффективность работы менеджера и аналитика.

Шкала соответствия между баллами (процентами),
выставляемыми по многобалльной (процентной) системе,
и отметками бинарной системы оценки знаний

Наименование отметки	**Сумма баллов (процентов)**
Отлично	86-100 баллов
Хорошо	71-85 баллов
Удовлетворительно	61-70 баллов
Неудовлетворительно	0-60 баллов

Шкала оценивания результатов обучения при осуществлении промежуточной аттестации

Критерий оценивания	**Оценка**
В типовых условиях осуществляет расчет и анализ показателей рисков и рисковых ограничений по этапам жизненного цикла проекта; использует современные	отлично

инструментальные методы экономического анализа для принятия рискованных решений исследовательских и практических задач; На основе действующих методик самостоятельно: определяет источники финансовых ресурсов, -оценивает возможности организаций по увеличению доходов; Самостоятельно, верно определяет экономические категории в сфере оценки финансовых рисков	
В типовых условиях осуществляет расчет и анализ показателей рисков и рисковых ограничений по этапам жизненного цикла проекта; использует современные инструментальные методы экономического анализа для принятия рискованных решений исследовательских и практических задач; допускает неточности в определениях; На основе действующих методик самостоятельно: определяет источники финансовых ресурсов, оценивает возможности организаций по увеличению доходов; Самостоятельно, верно определяет экономические категории в сфере оценки финансовых рисков	хорошо
В типовых условиях осуществляет расчет и анализ показателей рисков и рисковых ограничений по этапам жизненного цикла проекта; использует современные инструментальные методы экономического анализа для принятия рискованных решений исследовательских и практических задач; допускает существенные ошибки; На основе действующих методик не уверенно: определяет источники финансовых ресурсов, оценивает возможности организаций по увеличению доходов; не верно определяет экономические категории в сфере оценки финансовых рисков	удовлетворительно
Не способен в типовых условиях осуществить расчет и анализ показателей финансовых рисков и рисковых ограничений, На основе действующих методик самостоятельно: - определяет источники финансовых ресурсов для формирования системы оценки рисков - оценивает возможности организаций по увеличению доходов; не идентифицирует финансовые риски; Не способен самостоятельно: верно определять экономические категории в сфере управлении финансовыми рисками, выявляет тенденции их развития	неудовлетворительно

6. Методические материалы по освоению дисциплины

Методические указания для обучающихся по освоению материала занятий лекционного типа

Лекция представляет собой систематизированное, последовательное изложение преподавателем учебного материала в соответствии с изучаемой темой дисциплины. Занятия лекционного типа дают обучающимся систематизированные знания о наиболее сложных и актуальных проблемах изучаемой дисциплины.

Осуществляя учебные действия на лекционных занятиях, обучающиеся должны внимательно воспринимать материал, подготовленный преподавателем, мыслить, добиваться понимания изучаемого предмета. Обучающимся рекомендуется вести конспект. В случае недопонимания какой-либо части предмета следует в установленном порядке задать вопрос преподавателю.

Для визуального восприятия формулировки темы, учебных вопросов, наиболее важных определений, схем, иллюстраций, таблиц, графиков, дополнительных источников информации и т. п. обучающимся рекомендуется обращать внимание на предлагаемые преподавателем учебные презентации в формате MS PowerPoint (или созданные с помощью иных приложений).

Методические указания для обучающихся по освоению материала занятий семинарского типа

Занятия семинарского типа (практические занятия) являются аудиторными. Для того, чтобы аудиторный материал занятия был освоен обучающимся, ему необходимо предварительно изучить

теоретический материал по данной теме, ознакомиться с литературой, рекомендованной преподавателем и найденной самостоятельно; выполнить задания, предложенные преподавателем к занятию; составить перечень вопросов, вызывающих затруднения, неясности или сомнения, обсудить их с преподавателем на занятии.

В ходе подготовки к семинарским занятиям обучающемуся рекомендуется изучить основную литературу, ознакомиться с дополнительной литературой, новыми публикациями в периодических изданиях. При этом следует учесть рекомендации преподавателя и требования рабочей программы. Рекомендуется также дорабатывать свой конспект лекции, делая в нем соответствующие записи из литературы, рекомендованной преподавателем и предусмотренной рабочей программой дисциплины.

Следует подготовить тезисы для выступлений по всем учебным вопросам, выносимым на практическое занятие.

Готовясь к выступлению на занятии, обучающийся может обращаться за методической помощью к преподавателю. Заканчивать подготовку следует составлением плана (конспекта) по изучаемому материалу (вопросу). Это позволяет составить концентрированное, сжатое представление по изучаемым вопросам.

Методические указания для обучающихся по самостоятельной работе

Самостоятельная работа обучающихся направлена на самостоятельное изучение отдельных вопросов учебной дисциплины. Самостоятельная работа является обязательной для каждого обучающегося, ее объем определяется учебным планом.

Усвоение материала дисциплины в процессе аудиторных занятий и в результате самостоятельной подготовки и изучения отдельных вопросов дисциплины позволят студенту подойти к промежуточной аттестации подготовленным и потребует лишь повторения ранее пройденного материала. Знания, накапливаемые постепенно и в различных ракурсах, с использованием противоположных мнений и взглядов на ту или иную проблему экономики являются глубокими и качественными, и позволяют сформировать соответствующие компетенции как итог образовательного процесса.

Для систематизации знаний по дисциплине первоначальное внимание обучающемуся следует обратить на рабочую программу курса, которая включает основные темы дисциплины, в рамках которых и формируются вопросы для текущего контроля и промежуточной аттестации. Поэтому обучающийся, заранее ознакомившись с программой курса, может лучше сориентироваться в последовательности освоения курса с позиций организации самостоятельной работы.

При организации процесса освоения дисциплины обучающемуся следует учитывать:

1. Планирование времени, отведенного на освоение дисциплины.

При планировании времени на освоение дисциплины следует руководствоваться: а) структурой дисциплины (раздел 3 настоящей рабочей программы), в которой указаны количество академических часов в разрезе каждой темы, вида занятий (лекции, практические занятия) и часы на самостоятельную работу; б) формой текущего контроля успеваемости (опрос, опорный конспект, тестирование, реферат); в) формой промежуточной аттестации (зачет).

2. Последовательность действий при освоении дисциплины. Изучение каждой темы дисциплины целесообразно начинать со знакомства с содержанием дисциплины в разрезе тем; затем следует этап подбора источников из числа рекомендуемых и подобранных самостоятельно (научные статьи; информация с официальных сайтов государственных органов, др.). Изучение источниковой базы может сопровождаться конспектированием (например, тезисным), составлением глоссария, др. Целесообразно вести перечень проблемных вопросов как по существу темы, обусловленных пробелами в научном и правовом поле и проблемами практического характера, так и в случае затруднений с уяснением смысла изложенного в источниках материала (указанные вопросы могут быть разрешены впоследствии самим студентом во время занятий или на консультации с преподавателем).

3. Использование учебно-методических материалов и работа с литературой. Следует применять следующую последовательность подбора источников для изучения тем дисциплины: а)

научная и учебная литература: основная и дополнительная; б) нормативные правовые материалы; в) Интернет-ресурсы и др.

4. Подготовка к текущему контролю успеваемости. При выполнении заданий следует руководствоваться методическими рекомендациями, представленными по каждому виду заданий (опрос/опорный конспект, реферат, тестирование).

При самостоятельной работе обучающиеся работают с рекомендованными материалами при минимальном участии преподавателя. При необходимости обучающемуся рекомендуется записывать вопросы, возникшие у него в ходе работы над темой, для обсуждения их с преподавателем в ходе семинаров или консультаций.

Методические указания для обучающихся по подготовке к опросу /составлению опорного конспекта

Опросы по темам проводятся в части проверки и уяснения основных экономических понятий и категорий. При подготовке к опросу обучающийся должен изучить вопросы для самостоятельной подготовки к практическим занятиям, рекомендуется составить краткий конспект ответа на каждый из представленных вопросов.

Конспект – это систематическая, логически связная запись материала, включающая в себя план изучаемого материала, выписки из учебника и дополнительных источников, тезисы материала, собственные мысли, выводы и т.п.

Методические указания для обучающихся по подготовке к тестированию

При подготовке к тестированию необходимо внимательно изучить содержание тем дисциплины, которые выносятся на проверку.

Как и любая другая форма подготовки к контролю знаний, тестирование имеет ряд особенностей, знание которых помогает успешно выполнить тест. Можно дать следующие методические рекомендации:

- прежде всего, следует внимательно изучить структуру теста, оценить объем времени, выделяемого на данный тест, увидеть, какого типа задания в нем содержатся;
- лучше начинать отвечать на те вопросы, в правильности решения которых нет сомнений, пока не останавливаясь на тех, которые могут вызвать долгие раздумья. Это позволит успокоиться и сосредоточиться на выполнении более трудных вопросов;
- очень важно всегда внимательно читать задания до конца, не пытаясь понять условия «по первым словам» или выполнив подобные задания в предыдущих тестированиях. Такая спешка нередко приводит к досадным ошибкам в самых легких вопросах;
- если не знаете ответа на вопрос или не уверены в правильности, следует пропустить его и отметить, чтобы потом к нему вернуться.

Рассчитывать выполнение заданий нужно всегда так, чтобы осталось время на проверку и доработку (примерно 1/3-1/4 запланированного времени). Тогда вероятность описок сводится к нулю и имеется время, чтобы набрать максимум баллов на легких заданиях и сосредоточиться на решении более трудных, которые вначале пришлось пропустить.

Методические указания по подготовке рефератов

Реферат – результат самостоятельной работы обучающегося, представляющий собой краткое изложение в письменном виде полученных результатов теоретического анализа определенной научной (учебно-исследовательской) темы, где автор раскрывает суть исследуемой проблемы, приводит различные точки зрения, а также собственные взгляды на нее. Реферат должен состоять из следующих частей: титульный лист; содержание; введение; основной текст, разбитый на главы и подразделы (вопросы); заключение; библиографический список. Реферат оформляется в соответствии с требованиями, предъявляемыми локальными нормативными актами РАНХиГС к письменным работам.

Методические рекомендации при применении ДОТи регламент распределения видов работ по дисциплине с ДОТ

Данная дисциплина может быть реализована с применением элементов дистанционных образовательных технологий (ДОТ). Распределение видов учебной работы, форматов текущего контроля представлены в таблице:

Вид учебной работы	**Формат проведения**
Лекционные занятия	контактная аудиторная работа / в СДО
Практические занятия	контактная аудиторная работа / в СДО
Самостоятельная работа	контактная аудиторная работа / в СДО
Промежуточная аттестация	Устно /устно в ДОТ
Формы текущего контроля	**Формат проведения**
Опрос/опорный конспект	контактная аудиторная работа / в СДО
Тестирование	контактная аудиторная работа / в СДО
Реферат	контактная аудиторная работа / в СДО

Доступ к системе дистанционных образовательных технологий (СДО) осуществляется каждым обучающимся самостоятельно с любого устройства на образовательном портале института: https://lms.ranepa.ru. Пароль и логин к личному кабинету / профилю предоставляется студенту в деканате.

Все формы текущего контроля, проводимые в системе дистанционного обучения, оцениваются в системе дистанционного обучения. Доступ к видео и материалам лекций предоставляется в течение всего семестра. Доступ к каждому виду работ и количество попыток на выполнение задания предоставляется на ограниченное время согласно регламенту дисциплины, опубликованному в СДО. Преподаватель оценивает выполненные обучающимся работы после окончания срока выполнения согласно установленному графику.

7. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети Интернет

7.1. Основная литература

1 Антонов Г. Д. Управление рисками организации[Электронный ресурс]: учебное пособие / Г. Д. Антонов, О. П. Иванова, В. М. Тумин. — М.: НИЦ ИНФРА-М, 2022. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — ISBN 978-5-16-010203-0 — Режим доступа: http://znanium.com/catalog/product/475625

2 Воронцовский А. В. Управление рисками [Электронный ресурс] : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2021 — 414 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-5409-8. — Режим доступа: https://www.biblio-online.ru/bcode/385283

3 Вяткин В. Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — М. : Издательство Юрайт, 2021. — 353 с. — (Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-8357-9. — Режим доступа: https://www.biblio-online.ru/bcode/394275

4 Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич, И. В. Пещанской. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 345 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01019-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/433674
М. : Издательство Юрайт, 2019 https://urait.ru/bcode/433674

7.2 Дополнительная литература

1. Гибсон, Роджер Формирование инвестиционного портфеля: Управление финансовыми рисками / Роджер Гибсон. — 2-е изд. — Москва : Альпина Бизнес Букс, 2019. — 280 с. — ISBN 978-5-9614-0775-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS :

[сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/82378.html Москва : Альпина Бизнес Букс 2019 http://www.iprbookshop.ru/82378.html

2. Стронгин, Р. Г. Исследование операций и модели экономического поведения : учебное пособие / Р. Г. Стронгин. — 3-е изд. — Москва : Интернет-Университет Информационных Технологий (ИНТУИТ), Ай Пи Ар Медиа, 2020. — 244 c. — ISBN 978-5-4497-0660-7. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/97546.html Москва : Интернет-Университет Информационных Технологий (ИНТУИТ), Ай Пи Ар Медиа 2020 http://www.iprbookshop.ru/97546.html

3. Тепман, Л. Н. Управление банковскими рисками : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по направлениям экономики и управления / Л. Н. Тепман, Н. Д. Эриашвили. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 311 c. — ISBN 978-5-238-02469-1. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/81575.html Москва : ЮНИТИ-ДАНА 2017 http://www.iprbookshop.ru/81575.html

7.3. **Нормативные правовые документы и иная правовая информация**

1. Конституция (Основной закон) Российской Федерации// Российская газета. 1993. № 237. http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_28399/

2 Указ Президента РФ от 13.05.2017 N208 "О Стратегии экономической безопасности Российской Федерации на период до 2030 года" http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_216629/942772dce30cfa36b671bcf19ca928e4d698a928/

3 Федеральный закон от 07.08.2001 N 115-ФЗ «О противодействии легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма»

7.4 Интернет-ресурсы

1. Агентство стратегических инициатив прогнозов [Электронный ресурс]. Режим доступа: https://asi.ru/
2. Ассоциация управления проектами «СОВНЕТ». Режим доступа:: http://www.sovnet.ru.
3. Интернет портал «Управление производством». Режим доступа: http://www.up-pro.ru.
4. Интернет-портал «Управление проектами». Режим доступа: http://forPM.ru
5. Информационно-аналитический журнал «Управление проектами». Режим доступа: http://www. https://pmmagazine.ru/.
6. Международная Ассоциация Управления Проектами (IPMA). Режим доступа: http:// https://www.ipma.world/.
7. Научная электронная библиотека «Киберленинка» [Электронный ресурс]. Режим доступа: https://cyberleninka.ru/
8. Правовая система «Гарант-Интернет» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http: // www.garweb.ru.
9. Правовая система «КонсультантПлюс» [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http: // www.consultantru.
10. Российская государственная библиотека. Электронная библиотека диссертаций РГБ. – URL.:http://www.rsl.ru.
11. Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Айбукс» http:// www.nwapa.spb.ru/index.php?page_id=76

7.5. Иные источники

1. http://e.lanbook.com - электронно-библиотечная система «Лань»
2. http://www.iprbookshop.ru– электронно-библиотечная система «IPRbooks»
3. http://www.biblio-onlain.ru– электронно-библиотечная система ЭБС «Юрайт»

8. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

Адрес	Наименование оборудованных учебных кабинетов	Оснащенность оборудованных учебных кабинетов, перечень программного обеспечения
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), практик, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Специализированные аудитории, оборудованные для проведения занятий по информационным технологиям (компьютерные классы)	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доска маркерная, учебные пособия, тренажеры и другие средства и оборудование. Аудитории обеспечены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде организации. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение, справочно-правовая система «Консультант плюс», информационно-справочная система «Кодекс», AnyLogicUniversity, KNIME (OpenSource программное обеспечение с открытым исходным кодом), Gretl, StatgraphicsCenturionXVAcademicPro, 1С Предприятие 8 для учебных заведений, EviewsAcademic, AdobePhotoshop
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Учебные аудитории для самостоятельной работы обучающихся	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.

680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Специализированная аудитория, оборудованная для проведения занятий по криминалистике / кабинет криминалистики	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доска маркерная, макеты, реактивы, раздаточные методические материалы и наглядные пособия, реквизит к осмотру места происшествия, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Учебный зал судебных заседаний	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доска маркерная, атрибуты, отражающие судебную символику (судебная мантия, герб и флаг Российской Федерации), молоток судьи, клетка для подсудимого, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33, Точка кипения	Центр (класс) деловых игр	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, учебно-наглядные пособия, доска маркерная, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Специальная библиотека (библиотека ограниченного доступа) /	Помещение для самостоятельной работы обучающихся. Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся, технические средства обучения, мультимедийное оборудование. Читальный зал научной библиотеки оснащен компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.

680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Кабинет иностранных языков	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доска маркерная, макеты, наглядные учебные пособия, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Криминалистический полигон	Оборудован специальными средствами и другими материально-техническими средствами для осуществления специальной подготовки обучающихся, манекен человека. Укомплектован переносным мультимедийным оборудованием, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Помещение для студенческой правовой консультации (юридическая клиника)	Помещение укомплектовано специализированной мебелью и переносным мультимедийным оборудованием, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Научно-исследовательская лаборатория	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доска маркерная, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Помещения для научно-исследовательской работы	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доска маркерная, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.

680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Актовый зал	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.

Информационные технологии реализуются через электронно-информационную образовательную среду Академии.

.