

Документ подписан простой электронной подписью.  
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 10.07.2025 14:04:52

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации**  
**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение**  
**высшего образования**  
**«Самарский государственный экономический университет»**

**Институт**      Институт менеджмента

**Кафедра**      Прикладного менеджмента

**УТВЕРЖДЕНО**

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 22 мая 2025 г. )

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

**Наименование дисциплины**      Б1.В.05 Управление рисками

**Основная профессиональная образовательная программа**      43.03.01 Сервис программа Управление гостиничным и ресторанным бизнесом

Квалификация (степень) выпускника Бакалавр

Самара 2025

## Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

## 1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Управление рисками входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Философия, Математические методы в экономике, Эконометрика, Основы финансового и экономического анализа, Технологии работы в социальных сетях, Информационно-коммуникационные технологии в профессиональной деятельности, История (история России, всеобщая история), История России, Консультационный проект, Экономика, финансы и маркетинг гостиничного и ресторанного бизнеса

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Управление рисками в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

### Универсальные компетенции (УК):

УК-1 - Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине                                                                                                                   |                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                  |
|----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                              | УК-1.1: Знать:                                                                                                                                                  | УК-1.2: Уметь:                                                                                                             | УК-1.3: Владеть (иметь навыки):                                                                                                                                                                                                  |
| УК-1                                         | процедуры критического анализа, методики анализа результатов исследования и разработки стратегий проведения исследований, организации процесса принятия решения | принимать конкретные решения для повышения эффективности процедур анализа проблем, принятия решений и разработки стратегий | методами установления причинно-следственных связей и определения наиболее значимых среди них; методиками постановки цели и определения способов ее достижения; методиками разработки стратегий действий при проблемных ситуациях |

### Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-5 - Способен использовать основы экономических знаний при оценке эффективности результатов деятельности на предприятии общественного питания

| Планируемые результаты обучения по программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине                                                 |                                                                                                            |                                                                                                                       |
|----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                              | ПК-5.1: Знать:                                                                                | ПК-5.2: Уметь:                                                                                             | ПК-5.3: Владеть (иметь навыки):                                                                                       |
| ПК-5                                         | основы экономических знаний при оценке эффективности результатов деятельности на предприятиях | использовать основы экономических знаний при оценке эффективности результатов деятельности на предприятиях | методикой оценки и анализа эффективности результатов деятельности на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса |

|  |                                        |                                        |  |
|--|----------------------------------------|----------------------------------------|--|
|  | гостиничного и<br>ресторанного бизнеса | гостиничного и<br>ресторанного бизнеса |  |
|--|----------------------------------------|----------------------------------------|--|

### 3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

#### Очная форма обучения

| Виды учебной работы                                              | Всего час/ з.е. |
|------------------------------------------------------------------|-----------------|
|                                                                  | Сем 7           |
| Контактная работа, в том числе:                                  | 36.15/1         |
| Занятия лекционного типа                                         | 18/0.5          |
| Занятия семинарского типа                                        | 18/0.5          |
| Индивидуальная контактная работа (ИКР)                           | 0.15/0          |
| Самостоятельная работа:                                          | 89.85/2.5       |
| Промежуточная аттестация                                         | 18/0.5          |
| Вид промежуточной аттестации:<br>Зачет                           | Зач             |
| Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы | 144             |
| Зачетные единицы                                                 | 4               |

### 4. Содержание дисциплины

#### 4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Управление рисками представлен в таблице.

#### Разделы, темы дисциплины и виды занятий

##### Очная форма обучения

| № п/п | Наименование темы<br>(раздела) дисциплины  | Контактная работа |                                 |      |     | Самостоятельная<br>работа | Планируемые<br>результаты<br>обучения в<br>соотношении с<br>результатами<br>обучения по<br>образовательной<br>программе |
|-------|--------------------------------------------|-------------------|---------------------------------|------|-----|---------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|       |                                            | Лекции            | Занятия<br>семинарского<br>типа | ИКР  | ГКР |                           |                                                                                                                         |
|       |                                            |                   | Практич.<br>занятия             |      |     |                           |                                                                                                                         |
| 1.    | Основы теории принятия<br>рисковых решений | 8                 | 8                               |      |     | 40                        | УК-1.1, УК-1.2, УК<br>-1.3, ПК-5.1, ПК-<br>5.2, ПК-5.3                                                                  |
| 2.    | Методы оценки и<br>управления риском       | 10                | 10                              |      |     | 49,85                     | УК-1.1, УК-1.2, УК<br>-1.3, ПК-5.1, ПК-<br>5.2, ПК-5.3                                                                  |
|       | Контроль                                   | 18                |                                 |      |     |                           |                                                                                                                         |
|       | Итого                                      | 18                | 18                              | 0.15 |     | 89.85                     |                                                                                                                         |

#### 4.2 Содержание разделов и тем

##### 4.2.1 Контактная работа

##### Тематика занятий лекционного типа

| №п/п | Наименование темы<br>(раздела) дисциплины   | Вид занятия<br>лекционного типа* | Тематика занятия лекционного типа                                 |
|------|---------------------------------------------|----------------------------------|-------------------------------------------------------------------|
| 1.   | Основы теории<br>принятия рисков<br>решений | лекция                           | Неопределенность и риск. Введение в теорию рисков                 |
|      |                                             | лекция                           | Факторы риска                                                     |
|      |                                             | лекция                           | Стратегии рискованных решений и основные методы управления риском |

|    |                                    |        |                                                                                       |
|----|------------------------------------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                    | лекция | Управленческий механизм риск-менеджмента                                              |
| 2. | Методы оценки и управления рисками | лекция | Измерение риска и критерии принятия рискованных решений                               |
|    |                                    | лекция | Методы оценки рисков                                                                  |
|    |                                    | лекция | Основные инструменты рискменеджмента. Приемы и способы управления рисками.            |
|    |                                    | лекция | Методы учета рисков долгосрочных инвестиционных проектов. Управление рисками проекта. |
|    |                                    | лекция | Портфельное инвестирование. Риск портфеля активов.                                    |

\*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

#### Тематика занятий семинарского типа

| №п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины     | Вид занятия семинарского типа** | Тематика занятия семинарского типа                                                    |
|------|--------------------------------------------|---------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|
| 1.   | Основы теории принятия рискованных решений | практическое занятие            | Неопределенность и риск. Введение в теорию рисков                                     |
|      |                                            | практическое занятие            | Факторы риска                                                                         |
|      |                                            | практическое занятие            | Стратегии рискованных решений и основные методы управления риском                     |
|      |                                            | практическое занятие            | Управленческий механизм риск-менеджмента                                              |
| 2.   | Методы оценки и управления рисками         | практическое занятие            | Измерение риска и критерии принятия рискованных решений                               |
|      |                                            | практическое занятие            | Методы оценки рисков                                                                  |
|      |                                            | практическое занятие            | Основные инструменты рискменеджмента. Приемы и способы управления рисками.            |
|      |                                            | практическое занятие            | Методы учета рисков долгосрочных инвестиционных проектов. Управление рисками проекта. |
|      |                                            | практическое занятие            | Портфельное инвестирование. Риск портфеля активов.                                    |

\*\* семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

#### Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

#### 4.2.2 Самостоятельная работа

| №п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины     | Вид самостоятельной работы ***                                                 |
|------|--------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|
| 1.   | Основы теории принятия рискованных решений | - подготовка доклада<br>- подготовка электронной презентации<br>- тестирование |
| 2.   | Методы оценки и управления рисками         | - подготовка доклада                                                           |

|  |  |                                                        |
|--|--|--------------------------------------------------------|
|  |  | - подготовка электронной презентации<br>- тестирование |
|--|--|--------------------------------------------------------|

\*\*\* самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

## 5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

### 5.1 Литература:

#### Основная литература

1. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/536576>

#### Дополнительная литература

1. Пименов, Н. А. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности : учебник и практикум для вузов / Н. А. Пименов. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 353 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16342-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/535920>

#### Литература для самостоятельного изучения

1. Воронцовский, А. В. Оценка рисков : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 179 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02411-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/487735>

2. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468977>

3. Основы риск-менеджмента / М. Кроуи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 390 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02578-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468418>

4. Помазанов, М. В. Управление кредитным риском в банке: подход внутренних рейтингов (ПВР) : практическое пособие для вузов / М. В. Помазанов ; под научной редакцией Г. И. Пенникаса. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 292 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12361-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/471030> (дата обращения: 26.11.2021).

5. Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов / В. Е. Шкурко ; под научной редакцией А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 182 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-05843-7. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/473824>

6. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 569 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13380-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/458713>

### 5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС ; ОС "Альт Рабочая станция" 10; ОС "Альт Образование" 10
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный, МойОфис Стандартный 3, МойОфис Профессиональный 3

### **5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся**

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)
3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
4. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

### **5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся**

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

### **5.5. Специальные помещения**

|                                                                                   |                                                                                                                                 |
|-----------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа                         | Комплекты ученической мебели<br>Мультимедийный проектор<br>Доска<br>Экран                                                       |
| Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа) | Комплекты ученической мебели<br>Мультимедийный проектор<br>Доска<br>Экран<br>Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ |
| Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций                     | Комплекты ученической мебели<br>Мультимедийный проектор<br>Доска<br>Экран<br>Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ |
| Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации                | Комплекты ученической мебели<br>Мультимедийный проектор<br>Доска<br>Экран<br>Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ |
| Помещения для самостоятельной работы                                              | Комплекты ученической мебели<br>Мультимедийный проектор<br>Доска<br>Экран<br>Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ |
| Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования              | Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования                                                                   |

## **6. Фонд оценочных средств по дисциплине Управление рисками:**

### **6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине**

| Вид контроля           | Форма контроля          | Отметить<br>нужное<br>знаком<br>« + » |
|------------------------|-------------------------|---------------------------------------|
| Текущий контроль       | Оценка докладов         | +                                     |
|                        | Устный/письменный опрос | +                                     |
|                        | Тестирование            | +                                     |
|                        | Практические задачи     | +                                     |
| Промежуточный контроль | Зачет                   | +                                     |

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

## 6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

### Универсальные компетенции (УК):

УК-1 - Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач

| Планируемые<br>результаты<br>обучения по<br>программе | Планируемые результаты обучения по дисциплине                                                                                                                   |                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                  |
|-------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                       | УК-1.1: Знать:                                                                                                                                                  | УК-1.2: Уметь:                                                                                                             | УК-1.3: Владеть (иметь навыки):                                                                                                                                                                                                  |
|                                                       | процедуры критического анализа, методики анализа результатов исследования и разработки стратегий проведения исследований, организации процесса принятия решения | принимать конкретные решения для повышения эффективности процедур анализа проблем, принятия решений и разработки стратегий | методами установления причинно-следственных связей и определения наиболее значимых среди них; методиками постановки цели и определения способов ее достижения; методиками разработки стратегий действий при проблемных ситуациях |
| Пороговый                                             | Основные приемы и способы обработки собранной информации для принятия управленческих решений в системе риск-менеджмент                                          | Анализировать проблемную ситуацию, осуществлять поиск и систематизацию информации для принятия управленческих решений      | Навыками анализа и систематизации данных, принятия управленческих решений                                                                                                                                                        |
| Стандартный (в дополнение к пороговому)               | Методы поиска, критического анализа и систематизации информации в целях идентификации, ранжирования рисков и принятия управленческих решений                    | Критически исследовать проблемную ситуацию, разработать эффективные процедуры принятия управленческих решений              | Навыками систематизации данных, разработки и содержательной аргументации управленческих решений по проблемной ситуации                                                                                                           |

|                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                   |
|------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Повышенн<br>ый (в<br>дополнение<br>к<br>пороговому<br>,<br>стандартно<br>му) | Методики критического анализа, установления причинно-следственных связей и систематизации информации в целях идентификации, оценки и ранжирования рисков, разработки стратегических и тактических решений в системе риск-менеджмента | На основе критического анализа и установления причинно-следственных связей выявлять и систематизировать факторы риска, разрабатывать стратегические и тактические решения в области управления рисками | Навыками оценки проблемной ситуации на основе использования инструментария риск-менеджмента в целях разработки оптимальных управленческих решений |
|------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

### **Профессиональные компетенции (ПК):**

ПК-5 - Способен использовать основы экономических знаний при оценке эффективности результатов деятельности на предприятии общественного питания

|                                                                              |                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                    |
|------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Планируем<br>ые<br>результаты<br>обучения по<br>программе                    | <b>Планируемые результаты обучения по дисциплине</b>                                                                              |                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                    |
|                                                                              | ПК-5.1: Знать:                                                                                                                    | ПК-5.2: Уметь:                                                                                                                                                                    | ПК-5.3: Владеть (иметь навыки):                                                                                                                                                                    |
|                                                                              | основы экономических знаний при оценке эффективности результатов деятельности на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса | использовать основы экономических знаний при оценке эффективности результатов деятельности на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса                                    | методикой оценки и анализа эффективности результатов деятельности на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса                                                                              |
| Пороговый                                                                    | Понятийный аппарат риск-менеджмента на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса                                           | Определять круг задач в рамках поставленной цели, выявлять проблемы и риски при оценке эффективности результатов деятельности на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса | Навыками анализа и оценки эффективных способов решения поставленных задач на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса                                                                      |
| Стандартны<br>й (в<br>дополнение<br>к<br>пороговому<br>)                     | Понятийный аппарат, методологию, законы и принципы управления рисками на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса         | Предлагать альтернативные способы решения задач, прогнозировать ожидаемые результаты с учетом имеющихся ресурсов, ограничение и рисков                                            | Практическими навыками анализа и оценки эффективных способов решения поставленных задач на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса с учетом рисков и ограничений                          |
| Повышенн<br>ый (в<br>дополнение<br>к<br>пороговому<br>,<br>стандартно<br>му) | Теорию риск-менеджмента на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса                                                       | Оценивать эффективность принятия управленческих решений на предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса, обосновывать их оптимальные варианты и прогнозировать ожидаемые      | Практическими навыками поиска и обоснования альтернативных решений проблемных ситуаций, анализа и оценки эффективных способов решения поставленных задач, прогнозирования ожидаемых результатов на |

|  |  |                                                                             |                                                  |
|--|--|-----------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------|
|  |  | результаты исходя из имеющихся ресурсов, ограничений и потенциальных рисков | предприятиях гостиничного и ресторанного бизнеса |
|--|--|-----------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------|

### 6.3. Паспорт оценочных материалов

| № п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины     | Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе | Вид контроля/используемые оценочные средства              |               |
|-------|--------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|---------------|
|       |                                            |                                                                                                   | Текущий                                                   | Промежуточный |
| 1.    | Основы теории принятия рискованных решений | УК-1.1, УК-1.2, УК-1.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3                                                    | Оценка презентаций<br>Тестирование<br>Практические задачи | Зачет         |
| 2.    | Методы оценки и управления риском          | УК-1.1, УК-1.2, УК-1.3, ПК-5.1, ПК-5.2, ПК-5.3                                                    | Оценка презентаций<br>Тестирование<br>Практические задачи | Зачет         |

### 6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

#### Примерная тематика докладов

| Раздел дисциплины                          | Темы                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Основы теории принятия рискованных решений | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Неопределенность и риск при инвестировании: направления отражения риска в расчетах экономической эффективности инвестиционных проектов.</li> <li>2. Разработка системы управления инвестиционными рисками.</li> <li>3. Анализ внешних и внутренних источников рисков инвестиционного проекта.</li> <li>4. Разработка стратегий управления рисками.</li> <li>5. Этапы управления рисками и их характеристика</li> <li>6. Диверсификация как стратегия уменьшения риска.</li> <li>7. Страхование рисков реализации и финансирования инвестиционных проектов.</li> <li>8. Направления самострахования инвестиционных рисков на предприятии.</li> <li>9. Использование предельных значений параметров инвестиционного проекта.</li> <li>10. Зарубежная практика риск-менеджмента</li> </ol> |
| Методы оценки и управления риском          | <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Анализ чувствительности показателей эффективности проекта к изменению исходных параметров</li> <li>2. Экономико-математические методы оценки риска</li> <li>3. Метод экспертных оценок</li> <li>4. Риски структуры активов по степени их ликвидности</li> <li>5. Риски потери платежеспособности. Построение шкалы риска потери платежеспособности</li> <li>6. Риски потери финансовой устойчивости</li> <li>7. Метод картографирования рисков</li> <li>8. Метод Монте-Карло</li> <li>9. Метод анализа чувствительности проекта</li> <li>10. Сценарный метод</li> </ol>                                                                                                                                                                                                                 |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 11. Метод Дельфи<br>12. Метод моделирования экономических процессов при оценке риска<br>13. Зарубежные модели прогнозирования банкротства<br>14. Отечественные модели прогнозирования банкротства<br>15. Финансовые риски<br>16. Бета-коэффициент при оценке финансовых рисков<br>17. Использование ценовой модели капитальных активов (САРМ) для расчета дохода по инвестиционному проекту с учетом риска<br>18. Коэффициент Шарпа при оценке финансовых рисков<br>19. Основные формы снижения риска: распределение риска между участниками<br>20. Синдикат как способ снижения рисков<br>21. Проектное финансирование как способ снижения рисков<br>22. Венчурное финансирование<br>23. Андеррайтинг на рынке ценных бумаг<br>24. Франчайзинг и факторинг как способы снижения рисков<br>25. Применение теории математических игр в риск-менеджменте<br>26. Математические методы рискового моделирования<br>27. Диагностика банкротства предприятий |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

**Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)**

размещены по ссылке: <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

**Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций**  
размещены по ссылке: <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

Как называются риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль?

- чистыми
- критическими
- спекулятивными

Как называются риски, которые обусловлены деятельностью самого предприятия?

- внешними
- внутренними
- чистыми

Какие из перечисленных рисков относятся к коммерческим?

- риск, связанный неисполнением сметы инвестиционного проекта
- риск, связанный с финансированием инвестиционного проекта
- риск, связанный с разрывом контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент
- риск, связанный с реализацией товара (услуг) на рынке

К группе финансовых рисков, связанных с покупательной ---способностью, относятся  
оборотный риск

- риск снижения доходности
- инфляционный риск
- валютный риск

К какой группе методов управления рисками относится использование набора мероприятий, дающих возможность полностью избежать влияния тех или иных неблагоприятных событий?

- методы компенсации рисков
- методы уклонения от рисков
- методы локализации рисков
- методы диверсификации рисков

К какой группе методов управления рисками относится передача финансирования риска на основе договора?

- методы локализации рисков
- методы компенсации рисков
- методы уклонения от рисков
- методы передачи рисков

На какие виды подразделяются риски по уровню финансовых потерь?

- допустимый, критический и катастрофический
- недопустимый, допустимый и критический;
- критический, катастрофический и недопустимый.

Расставьте функции риск-менеджмента в правильной последовательности

- 1.контроль риска
- 2.реагирование на риск
- 3.оценка риска
- 4.идентификация риска

Что является принципом действия механизма диверсификации?

- избегание рисков
- + разделение рисков
- отказ от рисков

Какой из перечисленных методов оценки риска основан на расчетах и анализе статистических показателей?

- вероятностный метод
- построение дерева решений
- метод сценариев
- анализ чувствительности

Управление риском – это

- отказ от рискованного проекта
- комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него
- комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска

Дисперсия и среднееквадратическое отклонение относится к такой группе оценки рисков как

- статистические методы
- математические методы
- философские методы

Определите относительную степень риска (коэффициент вариации проекта), если стандартное отклонение равно 10,14, среднее ожидаемое значение 118,5 тыс. руб.

- 0,09
- 0,9
- 1
- 0,034

Исходя из предположения, что предприятие имеет низкую толерантность к риску, определить наиболее подходящего исполнителя проекта, если при расчете показателей по первому исполнителю коэффициент вариации равен 0,09, по второму – 0,31

- исполнитель 1
- исполнитель 2

Даны NPV наилучшему, наихудшему и ожидаемому варианту: 13 839 тыс. руб., -13 502 тыс. руб. и 860 тыс. руб. Вероятность реализации наилучшего и наихудшего варианта -20%, ожидаемого

варианта – 60%. Определите среднее ожидаемое значение NPV для расчета риска проекта --583,4 тыс. руб.

-1 197 тыс. руб.

-15 201 тыс. руб.

Предположим, что бюджет проекта составит 120 тыс. руб. с вероятностью 80%, 100 тыс. руб. с вероятностью 15% и 150 тыс. руб. с вероятностью 5%. Определите среднее ожидаемое значение бюджета проекта для расчета риска проекта

-118,5 тыс. руб.

-81000 тыс. руб.

-54,6 тыс. руб.

Объективный метод определения вероятности основан на

-экспертных оценках

-вычислении частоты, с которой происходят некоторые события

-комбинировании вычисления частоты, с которой происходят некоторые события

-нет верного ответа

Какой прогнозируемостью характеризуется наступления события (Pt) при полной определенности?

-0,3

-0,7

-близкой к единице

-близкой к нулю

Анализ чувствительности ЧДД показывает

-эффективен ли проект

-является ли проект финансово реализуемым

-насколько сильно изменится ЧДД при изменении исходных данных

-какой доход получит фирма

Коэффициент вариации по проекту А составил 0,8, по проекту В – 0,5, по проекту С – 0,7. Какой проект является менее рискованным?

-проект А

-проект В

-проект С

Для инвестиционного проекта А рассчитайте математическое ожидание (среднее ожидаемое значение) доходности, если ЧДД оптим. 900 тыс. руб., ЧДД ожидаем. - 700 тыс. руб., а ЧДДпессим. – 500 тыс. руб. Вероятность оптимистического сценария – 0,3, пессимистического – 0,2.

- 720 тыс руб.

- 820 тыс. руб.

-2100 тыс. руб.

-1767 тыс руб.

**Практические задачи (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с электронным изданием, если имеется)**

| Раздел дисциплины                          | Задачи                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Основы теории принятия рискованных решений | <b>Задача 1.</b><br>Дайте количественную оценку предпринимательских рисков «Швейной фабрики» (табл.1) и составьте перечень возможных мероприятий, которые позволят снизить воздействие рисков, опираясь на данные статистики:<br>вероятность возникновения риска некачественного выполнения работ увеличится с уменьшением разрядов работающего персонала. Ущерб от этого риска |

(который в среднем составляет порядка 500 долл. в год) уменьшается в 2 раза, если большинство сотрудников имеют стаж работы от 1 года и разряд, начиная с третьего;

внутренние техногенные риски (пожары и аварии от неправильного обращения с электроприборами) возникают в среднем 2 раза в год. Если офис будет оборудован системой противопожарной безопасности (тепловыми датчиками и т.д.), то вероятность возникновения пожара составит 1 раз в два года. Стоимость имущества, находящегося в зоне бедствия, составляет 1790 долл;

выход оборудования из строя происходит в основном по причине резких колебаний напряжения в сети.

По другим видам рисков статистика не ведется.

Таблица 1

| Предпринимательские риски             | Ущерб до осуществления мероприятий по управлению рисками, долл. | Ущерб после осуществления мероприятий по управлению рисками, долл. |
|---------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------|
| Риск некачественного выполнения работ |                                                                 |                                                                    |
| Риск выхода оборудования из строя     |                                                                 |                                                                    |
| Риск пожара и аварий                  |                                                                 |                                                                    |

Достаточно ли собранной информации и проведенных расчетов для того, чтобы приступить к реализации предложенных выше мероприятий?

#### Задача 2.

На основе данных, собранных при прохождении практики, студенты дают характеристику реально действующего предприятия и его продукции, выявляют наиболее значимые для него риски. Описание предприятия должно включать в себя следующие данные:

название организации;

виды деятельности;

масштаб деятельности (размер бизнеса);

регион, в котором работает предприятие;

объемы производства и реализации продукции (оказания услуг);

численность персонала;

финансовая отчетность предприятия;

другие данные, которые студенты посчитают необходимыми.

Далее на основе метода экспертных оценок студентам необходимо дать оценку выявленным рискам, проранжировать их с точки зрения значимости и вероятности возникновения.

#### Задача 3.

На основе данных предыдущей задачи студентам необходимо представить перечень возможных методов управления выявленными рисками.

Результаты работы группы презентуются ее представителем в виде короткого доклада, а затем подвергаются обсуждению. Работа группы оценивается не только по качеству представленных результатов, но и по степени ее участия в обсуждении.

#### Задача 4.

Построить карту рисков на основе данных таблицы 1.

Таблица 1

| Вид риска                                           | Вероятность возникновения риска, доли единицы | Потери в результате воздействия рисков, тыс. долл. |
|-----------------------------------------------------|-----------------------------------------------|----------------------------------------------------|
| Риск нарушения сроков и объемов поставки материалов | 0,40                                          | 200                                                |

|  |                                                                                     |      |      |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------|------|------|
|  | Риск отсутствия материалов и ресурсов необходимого качества и свойств               | 0,30 | 250  |
|  | Риск изменения состояния грунта                                                     | 0,20 | 1700 |
|  | Риск задержки платежей инвестором                                                   | 0,20 | 700  |
|  | Риск нарушения согласованности финансовых потоков                                   | 0,25 | 400  |
|  | Риск срыва планов реализации проекта из-за ошибок в инвестиционном/финансовом плане | 0,40 | 780  |
|  | Риск возникновения несчастного случая                                               | 0,10 | 2000 |

Методы оценки и управления риском

### Задача 5.

Даны три варианта рискованных инвестиций и выделены четыре будущих состояний экономики (табл.1). Проверьте, выполняются ли условия абсолютного доминирования и доминирования по состоянию в каждом случае. Поясните отличия рассматриваемых видов доминирования

Таблица 1

| Акция | Будущее состояние экономики |           |           |           |
|-------|-----------------------------|-----------|-----------|-----------|
|       | 1-е                         | 2-е       | 3-е       | 4-е       |
|       | $P_1=0,2$                   | $P_2=0,4$ | $P_3=0,1$ | $P_4=0,3$ |
| 1     | 16                          | 15        | 19        | 20        |
| 2     | 13                          | 14        | 13        | 9         |
| 3     | 14                          | 10        | 12        | 11        |

### Задача 6.

Проверьте, выполняется ли для данных, приведенных в таблице 1, условия доминирования по вероятности

Таблица 1

| Акция | Будущее состояние экономики |           |           |           |
|-------|-----------------------------|-----------|-----------|-----------|
|       | 1-е                         | 2-е       | 3-е       | 4-е       |
|       | $P_1=0,2$                   | $P_2=0,4$ | $P_3=0,1$ | $P_4=0,3$ |
| 1     | 5                           | 15        | 30        | 12        |
| 2     | 12                          | 34        | 35        | 15        |
| 3     | 11                          | 20        | 30        | 14        |

### Задача 7.

Используя данные, приведенные в табл. 1, рассчитайте ожидаемую доходность и риск в форме дисперсии и стандартного отклонения. Заполните недостающие данные в таблице и сделайте выводы

Таблица 1

| Акция | Будущее состояние экономики |           |           |           | Характеристика рискованного проекта |   |          |
|-------|-----------------------------|-----------|-----------|-----------|-------------------------------------|---|----------|
|       | 1-е                         | 2-е       | 3-е       | 4-е       | Ожидаемая доходность                | D | $\delta$ |
|       | $P_1=0,2$                   | $P_2=0,4$ | $P_3=0,1$ | $P_4=0,3$ |                                     |   |          |
| 1     | 16                          | 15        | 19        | 20        |                                     |   |          |
| 2     | 13                          | 14        | 13        | 9         |                                     |   |          |
| 3     | 14                          | 10        | 12        | 11        |                                     |   |          |

### Задача 8.

Используя данные, приведенные в табл. 1, приведите расчеты полудисперсии для акций каждого вида. Сравните оценку риска в форме дисперсии и полудисперсии.

Таблица 1

| Акция | Будущее состояние экономики |                     |                     |                     | Характеристика рискового проекта |   |   |
|-------|-----------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|----------------------------------|---|---|
|       | 1-е                         | 2-е                 | 3-е                 | 4-е                 | Ожидаемая доходность             | D | δ |
|       | P <sub>1</sub> =0,2         | P <sub>2</sub> =0,4 | P <sub>3</sub> =0,1 | P <sub>4</sub> =0,3 |                                  |   |   |
| 1     | 16                          | 15                  | 19                  | 20                  |                                  |   |   |
| 2     | 13                          | 14                  | 13                  | 9                   |                                  |   |   |
| 3     | 14                          | 10                  | 12                  | 11                  |                                  |   |   |

**Задача 9.**

Используя данные, приведенные в табл. 1, приведите расчеты полудисперсии для акций каждого вида. Сравните оценку риска в форме дисперсии и полудисперсии.

Таблица 1

| Акция | Будущее состояние экономики |                     |                     |                     | Характеристика рискового проекта |   |   |
|-------|-----------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|----------------------------------|---|---|
|       | 1-е                         | 2-е                 | 3-е                 | 4-е                 | r                                | D | δ |
|       | P <sub>1</sub> =0,2         | P <sub>2</sub> =0,4 | P <sub>3</sub> =0,1 | P <sub>4</sub> =0,3 |                                  |   |   |
| 1     | 16                          | 15                  | 19                  | 20                  |                                  |   |   |
| 2     | 13                          | 14                  | 13                  | 9                   |                                  |   |   |
| 3     | 14                          | 10                  | 12                  | 11                  |                                  |   |   |

**Задача 10.**

Используя данные таблицы, определите более предпочтительную акцию по величине коэффициента вариации. Поясните смысл полученных результатов.

Таблица 1

| Акция | Будущее состояние экономики |                     |                     |                     | Характеристика рискового проекта |   |   |
|-------|-----------------------------|---------------------|---------------------|---------------------|----------------------------------|---|---|
|       | 1-е                         | 2-е                 | 3-е                 | 4-е                 | r                                | δ | V |
|       | P <sub>1</sub> =0,2         | P <sub>2</sub> =0,4 | P <sub>3</sub> =0,1 | P <sub>4</sub> =0,3 |                                  |   |   |
| 1     | 16                          | 15                  | 19                  | 20                  |                                  |   |   |
| 2     | 13                          | 14                  | 13                  | 9                   |                                  |   |   |
| 3     | 14                          | 10                  | 12                  | 11                  |                                  |   |   |

**Задача 11**

Определите, какой из видов деятельности является наименее рискованным, если известны данные о рентабельности каждого вида деятельности за ряд лет (табл.1).

Рентабельность видов деятельности А и Б

Таблица 1

| Год    | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 |
|--------|------|------|------|------|
| Рен. А | 0,26 | 0,28 | 0,17 | 0,37 |
| Рен. Б | 0,11 | 0,65 | 0,26 | 0,1  |

**Задача 12**

Определите уровень ценового риска по данным экспертного опроса (табл.1). Уровень значимости экспертов: Иванов – 0,8; Сидоров – 0,6.

Таблица 1

| Планируемое изменение цены | Иванов      |                | Сидоров     |                |
|----------------------------|-------------|----------------|-------------|----------------|
|                            | Вероятность | Цена, руб./шт. | Вероятность | Цена, руб./шт. |
| Цена вырастет              | 0,3         | 15             | 0,1         | 12             |
| Цена не изменится          | 0,5         | 10             | 0,4         | 10             |
| Цена снизится              | 0,2         | 8              | 0,5         | 8              |

**Задача 13**

Рассчитайте риск и доходность ценных бумаг А и В, а также риск и доходность портфеля, состоящего из ценных бумаг А и В, если доля ценной бумаги А составляет 30%, доля ценной бумаги В – 70%. Значения доходности данных ценных бумаг приведены в таблице 1.

Таблица 1

| Годы | Доходность А | Доходность В |
|------|--------------|--------------|
| 1    | 0,1          | 0,12         |
| 2    | 0,16         | 0,18         |
| 3    | 0,14         | 0,14         |
| 4    | 0,17         | 0,15         |

**Задача 14**

На основе данных таблицы, определить риск и доходность портфеля, состоящего из двух ценных бумаг, доля каждой из которой в портфеле 0,5.

Рассчитайте доходность и риск вложений в каждую ценную бумагу и соотнесите с доходностью и риском портфеля.

Таблица 1

| Год | Доходность А, % | Доходность В, % |
|-----|-----------------|-----------------|
| 1   | 8               | 14              |
| 2   | 10              | 15              |
| 3   | 5               | -10             |
| 4   | - 1             | 0               |
| 5   | 4               | 20              |

**Задача 15**

Выберите наименее рисковый вариант вложения капитала:

Таблица 1

| Вариант | Результаты деятельности (прибыль) |         |         |
|---------|-----------------------------------|---------|---------|
|         | 1 (0,2)                           | 2 (0,5) | 3 (0,3) |
| А       | 80                                | 90      | 110     |
| В       | 70                                | 40      | 30      |
| С       | 40                                | 60      | 70      |

**Задача 16**

Рассчитайте среднее ожидаемое значение.

Данные для расчета. При вложении капитала в мероприятие А из 200 случаев прибыль 25 тыс. руб. была получена в 20 случаях, 30 тыс. руб. была получена в 80 случаях, прибыль 40 тыс. руб. была получена в 100 случаях. При вложении капитала в мероприятие Б из 240 случаев прибыль 30 тыс. руб. была получена в 144 случаях, прибыль 35 тыс. руб. была получена в 72 случаях, прибыль 45 тыс. руб. была получена в 24 случаях.

**Задача 17**

Эксперты компании «АРС» определили следующие показатели прибыли в зависимости от ситуации на рынке (в млн. руб.):

Таблица 1

| Стратегия компании | Прибыль в зависимости от ситуации |             |             |
|--------------------|-----------------------------------|-------------|-------------|
|                    | Ситуация №1                       | Ситуация №2 | Ситуация №3 |
| 1.Холодильники     | 48                                | 67          | 52          |
| 2.Морозильники     | 89                                | 24          | 46          |
| 3.Кондиционеры     | 72                                | 49          | 76          |

Если существует риск (эксперты считают наиболее вероятным реализацию ситуации №1 – 40%, №2 –35%, №3 –25%), то какую стратегию следует считать

оптимальной?

### Задача 18

Провести анализ чувствительности ЧДД проекта строительства производственного предприятия. Исходные данные приведены в табл. 1. Факторы для анализа чувствительности – это объем производства и цена 1 единицы продукции

Таблица 1

| Показатели                                                          | 1   | 2   | 3   | 4   | 5   | 6   |
|---------------------------------------------------------------------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| Инвестиции, тыс. руб.                                               | 450 | 450 |     |     |     |     |
| Объем производства, м <sup>3</sup> /кв.                             |     |     | 800 | 800 | 800 | 800 |
| Цена единицы продукции, тыс. руб. / м <sup>3</sup>                  |     |     | 5   | 5   | 5   | 5   |
| Переменные затраты на единицу продукции, тыс. руб. / м <sup>3</sup> |     |     | 4   | 4   | 4   | 4   |
| Постоянные расходы, тыс. руб., в том числе амортизация              |     |     | 200 | 200 | 200 | 200 |
|                                                                     |     |     | 50  | 50  | 50  | 50  |

## 6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

### Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

| Раздел дисциплины                          | Вопросы                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Основы теории принятия рискованных решений | 1. Место и роль рисков в экономической деятельности<br>2. Особенности рисков предпринимательской деятельности<br>3. Управление рисками как специфическая область менеджмента<br>4. Сущность риск-менеджмента как системы управления риском и экономическими отношениями<br>5. Процесс управления риском и его основные этапы<br>6. Особенности принятия решений в условиях неопределенности будущих результатов<br>8. Внешние риски<br>9. Внутренние риски<br>10. Этапы управления рисками и их характеристика<br>11. Идентификация рисков.<br>12. Характеристика оценки и анализа рисков. Выбор методов оценки, адекватных каждому виду рисков<br>13. Содержание и основные принципы разработки стратегий управления рисками<br>14. Характеристика основных стратегий управления риском<br>15. Основные мероприятия тактики управления рисками<br>16. Косвенные методы учета риска |
| Методы оценки и управления риском          | 17. Направления отражения риска в расчетах эффективности инвестиций<br>18. Классификация направлений и методов оценки риска<br>19. Учет рисков в исходной информации<br>20. Учет рисков при обосновании рискованной премии<br>21. Экспертный метод обоснования величины рискованной премии<br>22. Статистический метод обоснования риска<br>23. Графическая интерпретация риска в зависимости от величины потерь                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

|  |                                                                                                                                |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 24. Характеристика вероятностных показателей оценки риска: дисперсии, среднего квадратичного отклонения, коэффициента вариации |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

#### 6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

##### Шкала и критерии оценивания

| Оценка       | Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------|
| «зачтено»    | УК-1, ПК-5                                                                      |
| «не зачтено» | Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне                         |