

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
СТАВРОПОЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**

**УТВЕРЖДАЮ**

Директор/Декан  
института экономики, финансов и  
управления в АПК  
Гунько Юлия Александровна

\_\_\_\_\_  
\_\_\_\_\_  
« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

**Рабочая программа дисциплины**

**ФТД.04 Оценка рисков в проектном менеджменте**

38.04.01 Экономика

Экономическая безопасность и финансовая разведка

магистр

заочная

## 1. Цель дисциплины

Целью дисциплины «Оценка рисков в проектном менеджменте» является усвоение обучающимися знаний в области управления рисками, которые является важным элементом рыночной экономики.

В процессе преподавания данного курса управление рисками рассматривается как система экономических и правовых отношений, обеспечивающих защиту имущественных интересов юридических и физических лиц. Основной задачей данного курса является использование результатов научных исследований и разработок, направленных на совершенствование процесса управленческой деятельности. Преподавание курса «Оценка и анализ рисков» преследует следующие основные цели: овладение методологией построения и применения математических моделей финансовых операций с учетом фактора риска; освоение типовых методов и моделей, используемых в анализе и оптимизации финансовых операций с учетом факторов риска; освоение технологии выработки решения в условиях риска и неопределенности

## 2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций ОП ВО и овладение следующими результатами обучения по дисциплине:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине
ПК-3 Способен определять направление развития организации	ПК-3.1 Владеет методами анализа информации, проводит анализ деятельности организации и оценивает ее текущее состояние	<b>знает</b> Методы сбора и обработки информации для анализа деятельности организаций <b>умеет</b> Составлять объективную оценку текущего состояния организации на основании собранных данных <b>владеет навыками</b> Инструментами и технологиями автоматизированного анализа больших массивов данных
УК-1 Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	УК-1.1 Анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними	<b>знает</b> Теоретические основы системного подхода и методологию анализа сложных ситуаций. <b>умеет</b> Формулировать проблему как целостную систему, выделяя её компоненты и подсистемы. <b>владеет навыками</b> Навыками построения графических моделей (карты проблем, диаграммы Исикава, сетевые модели).
УК-1 Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	УК-1.2 Осуществляет поиск вариантов решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации. Разрабатывает стратегию действий и предлагает направления ее	<b>знает</b> Принципы эффективного поиска и отбора информации из различных источников (базы данных, интернет-ресурсы, внутренние корпоративные документы) <b>умеет</b> Проводить глубокий анализ доступной информации для выявления лучших подходов к решению конкретной проблемы



1.	1 раздел. Оценка бизнеса в условиях риска									
1.1.	Сущность и классификация финансовых рисков при угрозе экономической безопасности	1					4		Устный опрос, Тест	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.2.	Понятие экономического риска предприятия и сущность проектного менеджмента	1					4		Устный опрос, Тест	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.3.	Терминология и базовые показатели проектного менеджмента	1					4		Устный опрос, Тест	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.4.	Контрольная точка № 1	1					2	КТ 1	Контрольная работа	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.5.	Эффект финансового и операционного рычага и оценка совокупного риска	1	1	1			6		Устный опрос, Тест	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.6.	Денежные потоки предприятия	1	1	1			6		Устный опрос, Тест	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.7.	Комплексное оперативное управление оборотными активами и краткосрочными обязательствами предприятия	1	2	1	1		6		Устный опрос, Тест	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.8.	Контрольная точка № 2	1	2		2		2	КТ 2	Контрольная работа	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.9.	Управление структурой капитала, стоимость капитала	1	2	1	1		6		Устный опрос, Тест	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.10.	Дивидендная политика на предприятиях	1					8		Устный опрос, Тест	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.11.	Финансовое планирование и прогнозирование в условиях экономической безопасности	1					6		Устный опрос, Тест	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.12.	Контрольная точка №3	1					6	КТ 3	Контрольная работа	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
1.13.	Промежуточная аттестация	1							Практико-ориентированные задачи и ситуационные задачи, Разноуровневые задачи и задания	УК-1.1, УК-1.2, ПК-3.1
	Промежуточная аттестация	За								
	Итого		72	4	4		60			
	Итого		72	4	4		60			

### 5.1. Лекционный курс с указанием видов интерактивной формы проведения занятий

Тема лекции (и/или наименование раздел) (вид интерактивной формы проведения занятий)/ (практическая подготовка)	Содержание темы (и/или раздела)	Всего, часов / часов интерактивных занятий/ практическая подготовка
Эффект финансового и операционного рычага и оценка совокупного риска	<p>Понятие эффекта финансового рычага и его воздействие на рентабельность собственного капитала.</p> <p>Суть эффекта операционного рычага и его связь с уровнем постоянных издержек предприятия.</p> <p>Комбинация эффектов финансового и операционного рычагов и оценка общего уровня риска предприятия.</p>	1/-
Денежные потоки предприятия	<p>Категории денежных потоков (операционная деятельность, инвестиции, финансирование).</p> <p>Значение анализа денежных потоков для понимания финансовой устойчивости предприятия.</p> <p>Расчет и интерпретация показателя свободного денежного потока (FCF).</p>	1/-
Комплексное оперативное управление оборотными активами и краткосрочными обязательствами предприятия	<p>Концепция оптимального соотношения оборотных активов и обязательств.</p> <p>Методы управления запасами, дебиторской задолженностью и кредиторской задолженностью.</p> <p>Комплексные подходы к снижению дефицита ликвидности и увеличению операционной эффективности.</p>	1/-
Управление структурой капитала, стоимость капитала	<p>Понятия собственного и заемного капитала, их преимущества и недостатки.</p> <p>Алгоритм расчета средней взвешенной стоимости капитала (WACC).</p> <p>Выбор оптимальной структуры капитала для минимизации общей стоимости заимствования.</p>	1/-
Дивидендная политика на предприятиях	<p>Цели и типы дивидендной политики (стабильные выплаты, фиксированный коэффициент выплат).</p> <p>Факторы, влияющие на выбор дивидендной политики (ликвидность, ожидания акционеров, перспективы роста).</p> <p>Последствия дивидендной политики для рыночной капитализации предприятия.</p>	/-
Итого		4

### 5.2.1. Семинарские (практические) занятия с указанием видов проведения занятий в интерактивной форме

Наименование раздела дисциплины	Формы проведения и темы занятий (вид интерактивной формы проведения занятий)/(практическая подготовка)	Всего, часов / часов интерактивных занятий/ практическая подготовка	
		вид	часы
Контрольная точка № 1	Контрольная точка № 1	Пр	0/-/-
Комплексное оперативное управление оборотными активами и краткосрочными обязательствами предприятия	Комплексное оперативное управление оборотными активами и краткосрочными обязательствами предприятия	Пр	1/-/-
Контрольная точка № 2	Контрольная точка № 2	Пр	2/-/-
Управление структурой капитала, стоимость капитала	Управление структурой капитала, стоимость капитала	Пр	1/-/-
Дивидендная политика на предприятиях	Дивидендная политика на предприятиях	Пр	0/-/-
Контрольная точка №3	Контрольная точка №3	Пр	0/-/-
Итого			

### 5.3. Курсовой проект (работа) учебным планом не предусмотрен

### 5.4. Самостоятельная работа обучающегося

Темы и/или виды самостоятельной работы	Часы
Сущность и классификация финансовых рисков при угрозе экономической безопасности	4
Понятие экономического риска предприятия и сущность проектного менеджмента	4
Терминология и базовые показатели проектного менеджмента	4

Контрольная точка № 1	2
Эффект финансового и операционного рычага и оценка совокупного риска	6
Денежные потоки предприятия	6
Комплексное оперативное управление оборотными активами и краткосрочными обязательствами предприятия	6
Контрольная точка № 2	2
Управление структурой капитала, стоимость капитала	6
Дивидендная политика на предприятиях	8
Финансовое планирование и прогнозирование в условиях экономической безопасности	6
Контрольная точка №3	6

## 6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающегося по дисциплине «Оценка рисков в проектном менеджменте» размещено в электронной информационно-образовательной среде Университета и доступно для обучающегося через его личный кабинет на сайте Университета. Учебно-методическое обеспечение включает:

1. Рабочую программу дисциплины «Оценка рисков в проектном менеджменте».
2. Методические рекомендации для организации самостоятельной работы обучающегося по дисциплине «Оценка рисков в проектном менеджменте».
3. Методические рекомендации по выполнению письменных работ (контрольная работа) (при наличии).
4. Методические рекомендации по выполнению контрольной работы студентами заочной формы обучения (при наличии)
5. Методические указания по выполнению курсовой работы (проекта) (при наличии).

Для успешного освоения дисциплины, необходимо самостоятельно детально изучить представленные темы по рекомендуемым источникам информации:

№ п/п	Темы для самостоятельного изучения	Рекомендуемые источники информации (№ источника)		
		основная (из п.8 РПД)	дополнительная (из п.8 РПД)	метод. лит. (из п.8 РПД)
1	Сущность и классификация финансовых рисков при угрозе экономической безопасности. Сущность и классификация финансовых рисков при угрозе экономической безопасности	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
2	Понятие экономического риска предприятия и сущность проектного менеджмента. Понятие экономического риска предприятия и сущность проектного менеджмента	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
3	Терминология и базовые показатели проектного менеджмента. Терминология и базовые показатели проектного менеджмента	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
4	Контрольная точка № 1. Контрольная точка № 1	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
5	Эффект финансового и операционного рычага и оценка совокупного риска. Эффект финансового и операционного рычага и оценка совокупного риска	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
6	Денежные потоки предприятия. Денежные потоки предприятия	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
7	Комплексное оперативное управление оборотными активами и краткосрочными обязательствами предприятия. Комплексное оперативное управление оборотными активами и краткосрочными обязательствами предприятия	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
8	Контрольная точка № 2. Контрольная точка № 2	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1

9	Управление структурой капитала, стоимость капитала. Управление структурой капитала, стоимость капитала	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
10	Дивидендная политика на предприятиях. Дивидендная политика на предприятиях	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
11	Финансовое планирование и прогнозирование в условиях экономической безопасности. Финансовое планирование и прогнозирование в условиях экономической безопасности	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1
12	Контрольная точка №3. Контрольная точка №3	Л1.1, Л1.2, Л1.3	Л2.1, Л2.2, Л2.3	Л3.1

## 7. Фонд оценочных средств (оценочных материалов) для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине «Оценка рисков в проектном менеджменте»

### 7.1. Перечень индикаторов компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Индикатор компетенции (код и содержание)	Дисциплины/элементы программы (практики, ГИА), участвующие в формировании индикатора компетенции	1	2	3
		1	2	3
ПК-3.1: Владеет методами анализа информации, проводит анализ деятельности организации и оценивает ее текущее состояние	Демографическая безопасность	x		
	Диагностика и мониторинг экономической безопасности		x	
	Кадровая безопасность		x	
	Ознакомительная практика	x	x	
	Оценка бизнеса в условиях риска	x		
УК-1.1: Анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними	Экономическая безопасность		x	
	Практика по профилю профессиональной деятельности	x		
УК-1.2: Осуществляет поиск вариантов решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации. Разрабатывает стратегию действий и предлагает направления ее реализации	Преддипломная практика		x	
	Системный анализ	x		
	Методы научных исследований	x		
	Преддипломная практика		x	
	Управление проектами	x		

### 7.2. Критерии и шкалы оценивания уровня усвоения индикатора компетенций, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

Оценка знаний, умений и навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций по дисциплине «Оценка рисков в проектном менеджменте» проводится в форме текущего контроля и промежуточной аттестации.

Текущий контроль проводится в течение семестра с целью определения уровня усвоения обучающимися знаний, формирования умений и навыков, своевременного выявления преподавателем недостатков в подготовке обучающихся и принятия необходимых мер по её

корректировке, а также для совершенствования методики обучения, организации учебной работы и оказания индивидуальной помощи обучающемуся.

Промежуточная аттестация по дисциплине «Оценка рисков в проектном менеджменте» проводится в виде Зачет.

За знания, умения и навыки, приобретенные студентами в период их обучения, выставляются оценки «ЗАЧТЕНО», «НЕ ЗАЧТЕНО». (или «ОТЛИЧНО», «ХОРОШО», «УДОВЛЕТВОРИТЕЛЬНО», «НЕУДОВЛЕТВОРИТЕЛЬНО» для дифференцированного зачета/экзамена)

Для оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности в университете применяется балльно-рейтинговая система оценки качества освоения образовательной программы. Оценка проводится при проведении текущего контроля успеваемости и промежуточных аттестаций обучающихся. Рейтинговая оценка знаний является интегрированным показателем качества теоретических и практических знаний и навыков студентов по дисциплине.

### Состав балльно-рейтинговой оценки студентов очной формы обучения

Для студентов очной формы обучения знания по осваиваемым компетенциям формируются на лекционных и практических занятиях, а также в процессе самостоятельной подготовки.

В соответствии с балльно-рейтинговой системой оценки, принятой в Университете студентам начисляются баллы по следующим видам работ:

№ контрольной точки	Оценочное средство результатов индикаторов достижения компетенций		Максимальное количество баллов
1 курс			
КТ 1	Контрольная работа		10
КТ 2	Контрольная работа		10
КТ 3	Контрольная работа		10
<b>Сумма баллов по итогам текущего контроля</b>			<b>30</b>
Посещение лекционных занятий			20
Посещение практических/лабораторных занятий			20
Результативность работы на практических/лабораторных занятиях			30
Итого			100
№ контрольной точки	Оценочное средство результатов индикаторов достижений компетенций	Максимальное количество баллов	Критерии оценки знаний студентов
1 курс			
КТ 1	Контрольная работа	10	Тестовые задания - 2 балла; Практико-ориентированные задачи репродуктивного уровня - 3 баллов; Практико-ориентированные задачи реконструктивного уровня - 5 баллов
КТ 2	Контрольная работа	10	Тестовые задания - 2 балла; Практико-ориентированные задачи репродуктивного уровня - 3 баллов; Практико-ориентированные задачи реконструктивного уровня - 5 баллов
КТ 3	Контрольная работа	10	Тестовые задания - 2 балла; Практико-ориентированные задачи репродуктивного уровня - 3 баллов; Практико-ориентированные задачи реконструктивного уровня - 5 баллов

## Критерии и шкалы оценивания результатов обучения на промежуточной аттестации

При проведении итоговой аттестации «зачет» («дифференцированный зачет», «экзамен») преподавателю с согласия студента разрешается выставлять оценки («отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «зачет») по результатам набранных баллов в ходе текущего контроля успеваемости в семестре по выше приведенной шкале.

В случае отказа – студент сдает зачет (дифференцированный зачет, экзамен) по приведенным выше вопросам и заданиям. Итоговая успеваемость (зачет, дифференцированный зачет, экзамен) не может оцениваться ниже суммы баллов, которую студент набрал по итогам текущей и промежуточной успеваемости.

При сдаче (зачета, дифференцированного зачета, экзамена) к заработанным в течение семестра студентом баллам прибавляются баллы, полученные на (зачете, дифференцированном зачете, экзамене) и сумма баллов переводится в оценку.

## Критерии и шкалы оценивания ответа на зачете

По дисциплине «Оценка рисков в проектном менеджменте» к зачету допускаются студенты, выполнившие и сдавшие практические работы по дисциплине, имеющие ежемесячную аттестацию и без привязке к набранным баллам. Студентам, набравшим более 65 баллов, зачет выставляется по результатам текущей успеваемости, студенты, не набравшие 65 баллов, сдают зачет по вопросам, предусмотренным РПД. Максимальная сумма баллов по промежуточной аттестации (зачету) устанавливается в 15 баллов

Вопрос билета	Количество баллов
Теоретический вопрос	до 5
Задания на проверку умений	до 5
Задания на проверку навыков	до 5

### Теоретический вопрос

5 баллов выставляется студенту, полностью освоившему материал дисциплины или курса в соответствии с учебной программой, включая вопросы рассматриваемые в рекомендованной программой дополнительной справочно-нормативной и научно-технической литературы, свободно владеющему основными понятиями дисциплины. Требуется полное понимание и четкость изложения ответов по экзаменационному заданию (билету) и дополнительным вопросам, заданных экзаменатором. Дополнительные вопросы, как правило, должны относиться к материалу дисциплины или курса, не отраженному в основном экзаменационном задании (билете) и выявляют полноту знаний студента по дисциплине.

4 балла заслуживает студент, ответивший полностью и без ошибок на вопросы экзаменационного задания и показавший знания основных понятий дисциплины в соответствии с обязательной программой курса и рекомендованной основной литературой.

3 балла дан недостаточно полный и недостаточно развернутый ответ. Логика и последовательность изложения имеют нарушения. Допущены ошибки в раскрытии понятий, употреблении терминов. Студент не способен самостоятельно выделить существенные и несущественные признаки и причинно-следственные связи. Студент может конкретизировать обобщенные знания, доказав на примерах их основные положения только с помощью преподавателя. Речевое оформление требует поправок, коррекции.

2 балла дан неполный ответ, представляющий собой разрозненные знания по теме вопроса с существенными ошибками в определениях. Присутствуют фрагментарность, нелогичность изложения. Студент не осознает связь данного понятия, теории, явления с другими объектами дисциплины. Отсутствуют выводы, конкретизация и доказательность изложения. Речь неграмотная. Дополнительные и уточняющие вопросы преподавателя не приводят к коррекции ответа студента не только на поставленный вопрос, но и на другие вопросы дисциплины.

1 балл дан неполный ответ, представляющий собой разрозненные знания по теме вопроса с существенными ошибками в определениях. Присутствуют фрагментарность, нелогичность изложения. Студент не осознает связь данного понятия, теории, явления с другими объектами дисциплины. Отсутствуют выводы, конкретизация и доказательность изложения. Речь неграмотная. Дополнительные и уточняющие вопросы преподавателя не приводят к коррекции ответа студента не только на поставленный вопрос, но и на другие вопросы дисциплины.

0 баллов - при полном отсутствии ответа, имеющего отношение к вопросу.

Задания на проверку умений и навыков

5 баллов Задания выполнены в обозначенный преподавателем срок, письменный отчет без замечаний. Работа выполнена в полном объеме с соблюдением необходимой последовательности.

4 балла Задания выполнены в обозначенный преподавателем срок, письменный отчет с небольшими недочетами.

2 баллов Задания выполнены с задержкой, письменный отчет с недочетами. Работа выполнена не полностью, но объем выполненной части таков, что позволяет получить правильные результаты и выводы.

1 баллов Задания выполнены частично, с большим количеством вычислительных ошибок, объем выполненной части работы не позволяет сделать правильных выводов.

0 баллов Задания выполнены, письменный отчет не представлен или работа выполнена не полностью, и объем выполненной части работы не позволяет сделать правильных выводов.

### **7.3. Примерные оценочные материалы для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины «Оценка рисков в проектном менеджменте»**

Вопросы к зачету

1. Дайте определение проекта.
2. В чем заключается отличие проектной деятельности от текущей оперативной работы?
3. Что такое «тройное ограничение проекта»?
4. Дайте определение риска проекта.
5. Укажите основные параметры рисков проекта.
6. Как влияет процесс определения требований проекта на риски проекта?
7. В чем заключается суть управления содержанием проекта?
8. Как влияет процесс управления содержанием проекта на риски проекта?
9. Как влияют процессы управления сроками проекта на риски проекта?
10. Как влияют процессы управления стоимостью проекта на риски проекта?
11. Дайте характеристику метода освоенного объема.
12. За счет чего использование метода освоенного объема позволяет снизить риски проекта?
13. Охарактеризуйте основные проблемы формирования бюджета проекта.
14. Опишите процессы управления качеством проекта в контексте риск-менеджмента.
15. Как идентификация участников проекта влияет на риски проекта?
16. Как коммуникации проекта влияют на риск проекта?
17. В чем суть процессов управления поставками проекта? Как они влияют на риски проекта?
18. Дайте характеристику процессов управления рисками проекта.
19. Охарактеризуйте процесс идентификации рисков проекта.
20. Опишите основные особенности качественного анализа рисков проекта.
21. В чем суть качественного анализа рисков проекта?
22. Опишите процесс планирования реагирования на риски.
23. Неопределенность как важнейшая характеристика проекта.
24. Существующие подходы к понятию «риск».
25. Основные признаки риска.
26. Классификации рисков.
27. Характеристика подходов к понятию «возможность».
28. Взаимосвязь рисков и возможностей.
29. Количественная оценка рисков с помощью показателей вариации (коэффициент корреляции).
30. Анализ чувствительности в риск-менеджменте.
31. Оценка рисков методом сценариев.
32. Оценка рисков методом имитационного моделирования Монте-Карло

1. К содержанию группы методов снижения риска не относятся:
  - а) управление активами и пассивами;
  - б) самострахование;
  - в) хеджирование;
  - г) методы предотвращения;
  - д) диверсификация;
  - е) активный риск-менеджмент.
2. К группе методов переноса риска относятся:
  - а) страхование;
  - б) диверсификация;
  - в) активный риск-менеджмент;
  - г) лимитирование;
  - д) локализация;
  - е) гарантия.
3. Метод переноса риска можно по-другому назвать:
  - а) метод отказа от риска;
  - б) метод снижения риска;
  - в) метод предупреждения риска;
  - г) метод передачи риска;
  - д) метод страхования риска;
  - е) метод резервирования риска.
4. Самым надежным методом управления рисками как с точки зрения субъекта экономики, так и с точки зрения всей экономики в целом, является:
  - а) метод снижения риска;
  - б) метод принятия риска;
  - в) метод резервирования риска;
  - г) метод внутреннего страхования риска;
  - д) метод переноса риска;
  - е) метод трансферта риска.
5. К основным направлениям метода переноса риска можно отнести:
  - а) заключение договора поручительства;
  - б) передача рисков поставщикам сырья;
  - в) диверсификация риска;
  - г) локализация последствий риска;
  - д) хеджирование;
  - е) диссипация рисков.
6. Метод, который осуществляется путем переноса хозяйственной деятельности, связанной с повышенным инвестиционным риском, в пределы небольшого дочернего субъекта экономики – это:
  - а) диверсификация риска;
  - б) распределение риска;
  - в) локализация риска;
  - г) резервирование риска;
  - д) внутреннее страхование риска;
  - е) лимитирование риска.
7. Диверсификация риска предполагает:
  - а) перераспределение риска во времени;
  - б) перераспределение риска в пространстве;
  - в) снижение степени риска и потерь;
  - г) перенос рисков деятельности в пределы небольшого дочернего предприятия;
  - д) нейтрализацию риска;
  - е) передачу риска партнерам по отдельным хозяйственным операциям путем заключения кон-трактов.
8. Метод диверсификации риска можно по-другому назвать как:
  - а) распределение риска;
  - б) локализация риска;

- в) перенос риска;
- г) трансферт риска;
- д) снижение степени риска;
- е) диссипация риска.

9. Диверсификация рисков в пространстве достигается следующими путями:

- а) перераспределением риска между участниками хозяйственного процесса;
- б) диверсификацией деятельности;
- в) снижением степени риска;
- г) трансфертом риска;
- д) дробление рынка сбыта;
- е) дробление рынка поставщиков.

10. Метод управления активами и пассивами состоит в том, что:

- а) он имеет целью тщательно сбалансировать наличные средства;
- б) его цель – свести к минимуму изменения в получаемом доходе и прибыли;
- в) он направлен на избежание чрезмерного риска путем динамического регулирования

основных параметров вложения капитала;

г) он предполагает ценовое регулирование посредством выработки ценовой стратегии пред-приятия;

- д) он предполагает лимитирование риска;
- е) он предполагает нейтрализацию риска через передачу части риска партнерам.

Темы рефератов

1. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.
2. Классификация рисков: виды, принципы, использование.
3. Прогнозирование, планирование и теория риска.
4. Принятие предпринимательских решений в условиях риска.
5. Факторы неопределенности в условиях рыночной экономики.
6. Виды рисков и способы их оценки.
7. Методы оценки эффективности управления рисками.
8. Методы оценки рисков предприятий.
9. Использование количественных методов анализа и оценки рисков.
10. Использование качественных методов анализа и оценки рисков.
11. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы.
12. Методы измерения рисков.
13. Модели оценки предпринимательских рисков.
14. Методы оценки рыночных и операционных рисков.
15. Использование специфических методов определения степени и меры риска.
16. Экспертные методы оценки рисков.
17. Организация и использование экспертных методов оценки риска.
18. Методы индивидуальной и групповой экспертных оценок: сходства и различия.
19. Подбор экспертов и формирование экспертных групп.
20. Принципы составления анкет для экспертного опроса.
21. Этапы процесса управления риском.
22. Учет рисков в бизнес-планировании.
23. Инновационные технологии в управлении рисками.
24. Роль субъективных факторов в управлении рисками.
25. Правовое обеспечение деятельности по управлению рисками в РФ.
26. Управление рисками в малом предпринимательстве.
27. Организация управления рисками на промышленном предприятии.
28. Организация управления рисками в финансово-кредитном учреждении.
29. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы.
30. Особенности управления рисками транснациональной корпорации.

Тема 1. Риск как экономическая категория, его сущность.

1. Понятие риска.
2. Причины возникновения экономического риска.
3. Классификация рисков.

4. Управление риском.

Тема 2. Методы оценки экономических рисков.

1. Методы теории математических игр.
2. Методы теории вероятностей.
3. Методы математической статистики.
4. Методы теории статистических решений.
5. Методы математического программирования.

Тема 3. Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности.

1. Принятие оптимальных решений в условиях неопределенности.
2. Матричные игры.
3. Понятие игры с природой.
4. Критерии оптимальности в условиях полной неопределенности.
5. Матрицы последствий и матрицы рисков.
6. Анализ связанной группы решений в условиях полной неопределенности.
7. Анализ связанной группы решений в условиях частичной неопределенности.
8. Оптимальность по Парето двухкритериальных финансовых операций в условиях

неопределенности

Тема 4. Статистические методы принятия решений в условиях риска.

1. Измерители и показатели финансовых рисков.
2. Комбинации ожидаемого значения и дисперсии как критерий риска.
3. Учет влияния асимметрии распределения вероятностей на риски.

Тема 5. Инвестиционные риски.

1. Методы вычисления VAR: аналитический (метод вариации-ковариации), историческое моделирование и статистическое моделирование (метод Монте-Карло).

2. Алгоритмы расчета интегрального инвестиционного риска.
3. Формирование оптимального инвестиционного портфеля.

Тема 6. Оценка риска на основе анализа безубыточности предприятия.

1. Анализ безубыточности.
2. Количественная оценка риска банкротства предприятия.

Тема 7. Кредитные риски.

1. Факторы, способствующие возникновению кредитных рисков.
2. Анализ кредитных рисков.
3. Приемы уменьшения кредитных рисков.
4. Эффективная процентная ставка.
5. Нарращение и выплата процентов в потребительском кредите.
6. Кредитные гарантии.

## 8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

а) Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

### основная

Л1.1 Кисляков Г. В., Кислякова Н. А. Менеджмент: основные термины и понятия [Электронный ресурс]: словарь. - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2023. - 176 с. – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/document?id=424723>

Л1.2 Коршунова Л. Н., Проданова Н. А., Зацаринная Е. И., Гендон А. Л., Рудская И. Б. Основы финансового менеджмента [Электронный ресурс]: учеб. пособие; ВО - Специалитет. - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2023. - 228 с. – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/document?id=428659>

Л1.3 Погодина Т. В., Попадюк Т. Г., Удальцова Н. Л. Инновационный менеджмент [Электронный ресурс]: учебник; ВО - Бакалавриат, Магистратура, Аспирантура. - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2023. - 343 с. – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/document?id=429502>

### дополнительная

Л2.1 Степанов А.А., Савина М.В. Креативный менеджмент [Электронный ресурс]: Учебник; ВО - Магистратура. - Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2019. - 252 с. – Режим доступа: <http://new.znaniium.com/go.php?id=1081693>

Л2.2 Е. И. Капустина, О. П. Григорьева, Ю. С. Скрипниченко, С. А. Молчаненко, М. Г. Барсуков; СтГАУ Оценка рисков в проектном менеджменте: учеб. пособие. - Ставрополь, 2017. - 2,70 МБ

Л2.3 Диммиева А. Р. Оценка рисков проектов развития и расширения производства [Электронный ресурс]: моногр. ; ВО - Аспирантура, Бакалавриат. - Москва: Русайнс, 2016. - 89 с. – Режим доступа: <https://book.ru/book/921384>

б) Методические материалы, разработанные преподавателями кафедры по дисциплине, в соответствии с профилем ОП.

Л3.1 Чернобай Н. Б., Левушкина С. В. Проектный менеджмент: учеб. пособие для организации самостоятельной работы студентов направления Менеджмент профиль «Управление бизнесом». - Ставрополь, 2023. - 2,39 МБ

### 9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

№	Наименование ресурса сети «Интернет»	Электронный адрес ресурса
1	Федеральная служба государственной статистики	<a href="https://rosstat.gov.ru">https://rosstat.gov.ru</a>
2	Управление федеральной службы государственной статистики по Северо-Кавказскому федеральному округу	<a href="http://stavstat.gks.ru/">http://stavstat.gks.ru/</a>

### 10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Специфика изучения данной дисциплины обусловлена формой обучения студентов, ее местом в подготовке бакалавров и временем, отведенным на освоение курса рабочим учебным планом.

Курс обучения делится на время, отведенное для занятий, проводимых в аудиторной форме (лекции, практические занятия) и время, выделенное на внеаудиторное освоение дисциплины, большую часть из которого составляет самостоятельная работа студента.

Лекционная часть учебного курса для студентов проводится в форме обзоров по основным темам. Практические занятия предусмотрены для закрепления теоретических знаний, углубленного рассмотрения наиболее сложных проблем дисциплины, выработки навыков структурно-логического построения учебного материала и отработки навыков самостоятельной подготовки.

Самостоятельная работа студента включает в себя изучение теоретического материала курса, выполнение практических заданий, подготовку к контрольно-обобщающим мероприятиям.

Для освоения курса дисциплины студенты должны:

- изучить материал лекционных и практических занятий в полном объеме по разделам курса;
- выполнить задание, отведенное на самостоятельную работу: подготовить и защитить реферат по утвержденной преподавателем теме, подготовиться к собеседованию, контрольной работе;

- продемонстрировать сформированность компетенций, закрепленных за курсом дисциплины во время мероприятий текущего и промежуточного контроля знаний.

Посещение лекционных и практических занятий для студентов очной и заочной формы является обязательным.

Уважительными причинами пропуска аудиторных занятий является:

- освобождение от занятий по причине болезни, выданное медицинским учреждением,
- распоряжение по деканату, приказ по вузу об освобождении в связи с участием в внутривузовских, межвузовских и пр. мероприятиях,
- официально оформленное свободное посещение занятий.

Пропуски отрабатываются независимо от их причины.

Пропущенные темы лекционных занятий должны быть законспектированы в тетради для лекций, конспект представляется преподавателю для ликвидации пропуска. Пропущенные

практические занятия отрабатываются в виде устной защиты практического занятия во время консультаций по дисциплине.

Контроль сформированности компетенций в течение семестра проводится в форме устного опроса на практических занятиях, выполнения контрольных работ и тестового контроля по теоретическому курсу дисциплины.

Методические указания для подготовки к практическим занятиям.

Студенту рекомендуется следующая схема подготовки к практическому занятию:

1. Проработать конспект лекций;
2. Прочитать основную и дополнительную литературу, рекомендованную по изучаемому разделу;
3. Ответить на вопросы плана практического занятия;
4. Выполнить домашнее задание;
5. Проработать тестовые задания и задачи;
6. При затруднениях сформулировать вопросы к преподавателю.

При подготовке к практическим занятиям следует руководствоваться указаниями и рекомендациями преподавателя, использовать основную литературу из представленного им списка. Для наиболее глубокого освоения дисциплины рекомендуется изучать литературу, обозначенную как «дополнительная» в представленном списке.

При подготовке доклада на практическое занятие желательно заранее обсудить с преподавателем перечень используемой литературы, за день до практического занятия предупредить о необходимых для предоставления материала технических средствах, напечатанный текст доклада предоставить преподавателю.

При использовании цитат и цифровых данных следует указывать их источники (номер в перечне литературы и страницы). Следует отметить, что работа должна выполняться строго в соответствии с методическими указаниями.

Если при изучении отдельных вопросов возникнут трудности, студент может обратиться к преподавателю за консультацией (устной или письменной).

Методические указания к анализу кейс-задач.

Кейс (в переводе с англ. – случай) представляет собой проблемную ситуацию, предлагаемую студентам в качестве задачи для анализа и поиска решения.

Обычно кейс содержит схематическое словесное описание ситуации, статистические данные, а также мнения и суждения о ситуациях, которые трудно предсказать или измерить. Кейс, охватывает такие виды речевой деятельности как чтение, говорение и письмо.

Кейсы наглядно демонстрируют, как на практике применяется теоретический материал. Данный материал необходим для обсуждения предлагаемых тем, направленных на развитие навыков общения и повышения профессиональной компетенции.

Зачастую в кейсах нет ясного решения проблемы и достаточного количества информации.

Типы кейсов:

- Структурированный (highlystructured) кейс, в котором дается минимальное количество дополнительной информации.
- Маленькие наброски (shortvignettes) содержащие, как правило, 1-10 страниц текста.
- Большие неструктурированные кейсы (longunstructuredcases) объемом до 50 страниц.

Способы организации разбора кейса:

- ведет преподаватель;
- ведет студент;
- группы студентов представляют свои варианты решения;
- письменная домашняя работа.

Для успешного анализа кейсов следует придерживаться ряда принципов:

- используйте знания, полученные в процессе лекционного курса;
- внимательно читайте кейс для ознакомления с имеющейся информацией, не торопитесь с выводами;

- не смешивайте предположения с фактами.

Анализ кейса должен осуществляться в определенной последовательности:

1. Выделение проблемы.
2. Поиск фактов по данной проблеме.
3. Рассмотрение альтернативных решений.

#### 4. Выбор обоснованного решения.

При проведении письменного анализа кейса помните, что основное требование, предъявляемое к нему, – краткость.

### 11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства и информационных справочных систем (при необходимости).

#### 11.1 Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Kaspersky Total Security - Антивирус

#### 11.3 Перечень программного обеспечения отечественного производства

1. Kaspersky Total Security - Антивирус

При осуществлении образовательного процесса студентами и преподавателем используются следующие информационно справочные системы: СПС «Консультант плюс», СПС «Гарант».

### 12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

№ п/п	Наименование специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Номер аудитории	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы
1	Учебная аудитория для проведения занятий всех типов (в т.ч. лекционного, семинарского, практической подготовки обучающихся), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации	Э-130	Оснащение: специализированная мебель в составе аудиторных кресел и столов - 182 шт., Монитор 17" LCD NEC-173V – 4 шт., Проектор Sanyo PLC – XM150L – 1 шт., Видеокамера управляемая Soni EVI-D70P – 1 шт., Экран с электроприводом DraperdRolleramic 508/200*300*401– 1 шт., трибуна для лектора – 1 шт., Стол руководителя пр ЮВШ 56.01.03.00-01 – 2 шт., микрофон настольный Beyerdynamic MTS 67/5 – 4 шт., микрофон врезной Beyerdynamic SHM 815A – 1 шт., Устройство регулирования температуры воздуха ALHi-H48 A5/S – 2 шт., Цветная проводная сенсорная панель 6,4"Crestron TPS-3100LB – 1 шт., коммутатор Kramer VP – 8x8A – 1 шт., выход в корпоративную сеть университета

		Э-149	Оснащение: Специализированная мебель на 30 посадочных места, персональный компьютер – 1 шт., трибуна аудиторная - 1 шт., мультимедиа-проектор - 1 шт., интерактивная Smart доска-1шт., учебно-наглядные пособия в виде презентаций, подключение к сети «Интернет», доступ в электронную информационно-образовательную среду университета, выход в корпоративную сеть университета.
2	Помещение для самостоятельной работы обучающихся, подтверждающее наличие материально-технического обеспечения, с перечнем основного оборудования		

### 13. Особенности реализации дисциплины лиц с ограниченными возможностями здоровья

Обучающимся с ограниченными возможностями здоровья предоставляются специальные учебники и учебные пособия, иная учебная литература, специальные технические средства обучения коллективного и индивидуального пользования, предоставление услуг ассистента (помощника), оказывающего обучающимся необходимую техническую помощь, а также услуги сурдопереводчиков и тифлосурдопереводчиков.

а) для слабовидящих:

- на промежуточной аттестации присутствует ассистент, оказывающий студенту необходимую техническую помощь с учетом индивидуальных особенностей (он помогает занять рабочее место, передвигаться, прочитать и оформить задание, в том числе записывая под диктовку);
- задания для выполнения, а также инструкция о порядке проведения промежуточной аттестации оформляются увеличенным шрифтом;
- задания для выполнения на промежуточной аттестации зачитываются ассистентом;
- письменные задания выполняются на бумаге, надиктовываются ассистенту;
- обеспечивается индивидуальное равномерное освещение не менее 300 люкс;
- студенту для выполнения задания при необходимости предоставляется увеличивающее устройство;

в) для глухих и слабослышащих:

- на промежуточной аттестации присутствует ассистент, оказывающий студенту необходимую техническую помощь с учетом индивидуальных особенностей (он помогает занять рабочее место, передвигаться, прочитать и оформить задание, в том числе записывая под диктовку);
- промежуточная аттестация проводится в письменной форме;
- обеспечивается наличие звукоусиливающей аппаратуры коллективного пользования, при необходимости поступающим предоставляется звукоусиливающая аппаратура индивидуального пользования;

- по желанию студента промежуточная аттестация может проводиться в письменной форме;

д) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата (тяжелыми нарушениями двигательных функций верхних конечностей или отсутствием верхних конечностей):

- письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением или надиктовываются ассистенту;
- по желанию студента промежуточная аттестация проводится в устной форме.

Рабочая программа дисциплины «Оценка рисков в проектном менеджменте» составлена на основе Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 11.08.2020 г. № 939).

Автор (ы)

\_\_\_\_\_ проф. , дэн Герасимов Алексей Николаевич

Рецензенты

\_\_\_\_\_ проф. , дэн Агаркова Любовь Васильевна

\_\_\_\_\_ доц. , кэн Нестеренко Алексей Викторович

Рабочая программа дисциплины «Оценка рисков в проектном менеджменте» рассмотрена на заседании Кафедра экономической безопасности, бизнес-анализа и статистики протокол № 30 от 24.03.2025 г. и признана соответствующей требованиям ФГОС ВО и учебного плана по направлению подготовки 38.04.01 Экономика

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_ Герасимов Алексей Николаевич

Рабочая программа дисциплины «Оценка рисков в проектном менеджменте» рассмотрена на заседании учебно-методической комиссии Институт экономики, финансов и управления в АПК протокол № 8 от 26.03.2025 г. и признана соответствующей требованиям ФГОС ВО и учебного плана по направлению подготовки 38.04.01 Экономика

Руководитель ОП \_\_\_\_\_