

НЕГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ПРОФЕССИОНАЛЬНОГО ОБРАЗОВАНИЯ
«САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ ГУМАНИТАРНЫЙ
УНИВЕРСИТЕТ ПРОФСОЮЗОВ»

Кафедра экономики и управления

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
УПРАВЛЕНИЕ ПРОЕКТНЫМИ РИСКАМИ В СКС

Основная профессиональная образовательная программа
высшего образования программы бакалавриата
по направлению подготовки

38.03.02. «Менеджмент»

Профиль подготовки
«Менеджмент организаций социально-культурной сферы»

Квалификация:
Бакалавр

Согласовано:
Руководитель ОПОП по направлению
38.03.02. «Менеджмент»
Профиль «Управление проектом»
доцент _____ Н.В.Маслова

Рассмотрена и утверждена на заседании кафедры
« 19 » мая 2022 г., протокол № 10

Зав. кафедрой _____ Е.Г.Хольнова

Рекомендована решением
Методического совета

«25» июня 2022 г., протокол №6

Секретарь МС _____ К.В. Газина

Автор-разработчик:
доцент _____ И.В.Упорова

Санкт-Петербург

СТРУКТУРА

1. Цель и задачи освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре ОПОП
3. Требования к результатам освоения дисциплины
4. Тематический план изучения дисциплины
5. Тематическое содержание дисциплины
6. План практических (семинарских) занятий
7. Образовательные технологии
8. План самостоятельной работы студентов
9. Контроль знаний по дисциплине
10. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины
11. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

1. Методические рекомендации по организации самостоятельной работы студентов
2. Методические рекомендации по подготовке к практическим (семинарским) занятиям

Оценочные и методические материалы

1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы
2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций, шкал оценивания
3. Типовые контрольные задания и методические материалы, процедуры оценивания знаний, умений и навыков

Глоссарий

Методические рекомендации для преподавателя по дисциплине

1. Цели и задачи освоения дисциплины:

Цель изучения дисциплины - формирование у студентов теоретических основ и практических навыков управления проектными рисками.

Задачами изучения дисциплины являются:

- освоение студентами методов оценки проектных рисков, в том числе факторов и показателей, характеризующих рискованность различных финансовых вложений;
- рассмотрение возможных подходов к организации и управлению проектными рисками.

2. Место учебной дисциплины в структуре ОПОП:

Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами

№ п/п	Наименование обеспечиваемых (последующих) дисциплин	№ разделов данной дисциплины, необходимых для изучения обеспечиваемых дисциплин							
		1	2	3	4	5	6	7	8
1.	Управленческие решения	+	+	+	+	+	+	+	+
2.	Риск-менеджмент в организациях	+	+	+	+	+	+	+	+

3. Требования к результатам освоения дисциплины:

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций с установленными к ним индикаторами:

Компетенции и индикаторы их достижения

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
ПК-3 Способен участвовать в разработке и управлении проектами и программами внедрения организационных, технологических и продуктовых инноваций в СКС	ОПК-3.1. <i>Знать</i> : понятие, сущность и виды рисков, особенности проектного риска; теоретические основы риск-менеджмента; особенности оценки и управления рыночными рисками; понятие и сущность показателя Value at risk (VaR) и методы его оценки; особенности оценки и управления кредитными рисками; методы оценки суверенного риска; механизм управления риском ликвидности; подходы и способы управления операционными рисками.
	ОПК-3.2. <i>Уметь</i> : количественно оценивать различные виды проектных рисков в СКС: рыночных, кредитных, суверенных, рисков ликвидности, операционных рисков.
	ОПК-3.3. <i>Владеть</i> : методами оценки различных видов рисков в СКС; навыками анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений

Знания, умения и навыки характеризуют этапы формирования компетенций и обеспечивают достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

4. Тематический план изучения дисциплины

См приложение

5. Тематическое содержание дисциплины

Тема 1. Риск как экономическая категория.

Понятие и сущность риска. Основные подходы к определению риска. Особенности риска как экономической категории. Соотношение понятия риска и неопределенности. Классификация рисков. Основные виды рисков. Проектный риск в системе предпринимательских рисков. Характеристика методов управления проектными рисками.

Тема 2. Система риск-менеджмента.

Организация управления финансовыми рисками на предприятии. Стратегия управления финансовыми рисками. Документальное обеспечение системы управления финансовыми рисками. Функция планирования и контроля в системе риск-менеджмента. Способы построения системы рисков предприятия.

Тема 3. Оценка и управление рыночными рисками.

Понятие и виды рыночных рисков. Показатели оценки рыночного риска. Модель оценки капитальных активов. Дюрация и чувствительность. Показатели оценки чувствительности производных ценных бумаг. Оценка риска доходности портфеля ценных бумаг. Особенности применения хеджирования для целей снижения рыночных рисков.

Тема 4. Показатель VaR и методы его оценки.

Понятие и сущность показателя Value at risk (VaR). Преимущества и недостатки показателя VaR. Параметры показателя VaR. Дельта-нормальный метод расчета VaR: сущность, порядок расчета, недостатки и достоинства. Метод исторического моделирования. Метод Монте-Карло. VaR в Рискметриках банка J.P. Morgan.

Тема 5. Оценка и управление кредитными рисками.

Понятие и виды кредитного риска. Кредитное событие: сущность и виды. Внешние и внутренние кредитные рейтинги. Классификация моделей оценки кредитного риска. Модели оценки кредитоспособности заемщика. Методы оценки дефолта контрагента. Модели оценки кредитного риска портфеля. Подверженность кредитному риску и уровень возмещения потерь. Методы управления кредитным риском.

Тема 6. Оценка суверенного риска.

Понятие суверенного риска и его составляющие. Система факторов суверенного риска. Взаимосвязь суверенного риска с другими финансовыми рисками. Показатели оценки суверенного риска. Рейтинговые системы стран.

Тема 7. Оценка и управление риском ликвидности.

Понятие и структура риска ликвидности. Механизм управления риском ликвидности. Ликвидность фондового рынка и ее составляющие. Оценка риска ликвидности актива и портфеля активов. Подходы Банка России к оценке балансовой ликвидности коммерческого банка.

Тема 8. Оценка и управление операционными рисками.

Понятие и виды операционных рисков. Проблемы управления операционными рисками. Подходы и способы управления операционными рисками. Особенности принятия решений в условиях неопределенности и риска. Методы оценки и управления операционным риском, предложенные в Новом Базельском соглашении по капиталу. Порядок расчета размера операционного риска по методике Банка России.

6. План семинарских (практических) занятий

№ п/п	Наименование разделов дисциплины	Тематика, содержание практических (семинарских) занятий, литература для подготовки к занятиям	Формируемые компетенции	Формы контроля усвоения знаний
1.	Риск как экономическая категория	Тема: Основные виды рисков <i>Цель:</i> познакомить студентов с классификацией рисков	ПК-3	Опрос, дискуссия, доклады (сообщения).

		<p><i>Вопросы для обсуждения:</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие риска. 2. Виды рисков 3. Классификационные признаки проектных финансовых рисков 4. Особенности управления различными видами проектных рисков. <p><i>Литература:</i> 1-3</p>		
2.	Система риск-менеджмента	<p>Тема: Формирование системы риск-менеджмента на предприятии.</p> <p><i>Цель:</i> познакомить студентов с процессами создания риск менеджмента на предприятии.</p> <p><i>Вопросы для обсуждения:</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Определение стратегических целей риск-менеджмента . 2. Разработка мероприятий по формированию риск-менеджмента. 3. Организационная форма управления риск - менеджмента. 4. Формы контроля достижения целей риск-менеджмента. <p><i>Литература:</i> 1-3</p>	ПК-3	Устный опрос, дискуссия, доклады (сообщения), эссе
3.	Оценка и управление рыночными рисками	<p>Тема: Оценка и управление рыночными рисками.</p> <p><i>Цель:</i> закрепить и углубить знания студентов в области анализа, оценки и управления рыночными рисками.</p> <p><i>Вопросы для обсуждения:</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Виды рыночных рисков и их особенности. 2. Оценка риска доходности ценной бумаги и портфеля. 3. Модель оценки капитальных активов. 4. Показатели чувствительности производных ценных бумаг. 5. Решение задач. <p><i>Литература:</i> 1-3</p>	ПК-3	Устный опрос, дискуссия, доклады (сообщения), тестирование, решение задач
4.	Показатель VaR и методы его оценки	<p>Тема: Показатель VaR и методы его оценки</p> <p><i>Цель:</i> закрепить и углубить знания студентов в области методов оценки рисков.</p> <p><i>Вопросы для обсуждения:</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Сущность и особенности показателя Value at risk. 2. Расчет Value at risk дельта-нормальным методом. 3. Расчет Value at risk методом исторического моделирования. 4. Расчет Value at risk на основе Рискметрик банка J.P. Morgan. 5. Решение задач. <p><i>Литература:</i> 1-3</p>	ПК-3	Опрос, доклады (сообщения), выполнение самостоятельного задания, решение задач
5.	Оценка и управление кредитными рисками	<p>Тема: Оценка и управление кредитными рисками</p> <p><i>Цель:</i> закрепить и углубить знания студентов в области анализа кредитных рисков.</p> <p><i>Вопросы для обсуждения:</i></p>	ПК-3	Устный опрос, доклады (сообщения), выполнение самостоятельного

		<p>1. Особенности оценки кредитного риска заемщика.</p> <p>2. Методы оценки вероятности дефолта.</p> <p>3. Модели управления кредитным риском портфеля.</p> <p>4. Применение рейтинговых оценок для управления кредитным риском.</p> <p>5. Решение задач.</p> <p><i>Литература:</i> 1-3</p>		задания, тестирование
6.	Оценка суверенного риска	<p>Тема: Оценка суверенного риска</p> <p><i>Цель:</i> закрепить теоретические знания студентов, полученные в ходе лекций и самостоятельной подготовки, относительно особенностей понятия суверенного риска, методов его анализа и оценки.</p> <p><i>Вопросы для обсуждения:</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Рейтинговая система США. 2. Рейтинговая система стран Евросоюза. 3. Рейтинговая система Японии. <p><i>Литература:</i> 1-3</p>	ПК-3	Устный опрос, доклады (сообщения).
7.	Оценка и управление риском ликвидности	<p>Тема: Оценка и управление риском ликвидности</p> <p><i>Цель:</i> закрепить теоретические знания и сформировать практические умения студентов в области анализа риска ликвидности.</p> <p><i>Вопросы для обсуждения:</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Сущность и понятие риска ликвидности. 2. Управления ликвидностью на основе метода разрывов. 3. Расчет показателей оценки ликвидности и ее риска. 4. Управление риском ликвидности портфеля ценных бумаг. 5. Решение задач.. <p><i>Литература:</i> 1-3</p>	ПК-3	Устный опрос, решение ситуационных задач, выполнение самостоятельного задания.
8.	Оценка и управление операционными рисками	<p>Тема: Оценка и управление операционными рисками.</p> <p><i>Цель:</i> закрепить теоретические знания и сформировать практические умения студентов в области анализа риска ликвидности</p> <p><i>Вопросы для обсуждения:</i></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие и виды операционного риска. 2. Анализ волатильности доходов. 3. Индикаторы деятельности компании. 4. Система внутреннего контроля. 5. Решение задач. <p><i>Литература:</i> 1-3</p>	ПК-3	Устный опрос, решение ситуационных задач, выполнение самостоятельного задания.

7. Образовательные технологии

При проведении учебных занятий по дисциплине для успешного освоения применяются различные образовательные технологии, которые обеспечивают развитие навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств.

Методы / Формы	Лекции (Л)	Семинарские занятия (С)
Диалого - дискуссионное обсуждение проблем	+	+
Работа в команде		+
Решение ситуационных задач		+
Поисковый метод (поиск материалов для написания рефератов и эссе, подготовки докладов и сообщений, сбор материалов для выполнения практических заданий)		+

8. Виды самостоятельной работы студентов

№ п/п	Содержание самостоятельной работы студентов	Формируемые компетенции	Форма отчетности студента
1	Изучение литературы и информационных ресурсов Интернета по теме	ПК-3	Опрос, подготовка докладов и сообщений, написание рефератов, эссе
2	Подготовка к опросу на семинарском занятии	ПК-3	Опрос, участие в дискуссии
3	Подготовка доклада или сообщения (письменно)	ПК-3	Текст доклада (сообщения)/ электронная презентация
4	Подготовка к решению ситуационных задач	ПК-3	Решенные задачи
5	Выполнение самостоятельных заданий	ПК-3	Текст выполненного задания
6	Подготовка к тестированию	ПК-3	Положительная оценка за тест

9. Контроль знаний по дисциплине

По дисциплине предусмотрено: текущий контроль и промежуточная аттестация.

Текущий контроль успеваемости студента – одна из составляющих оценки качества усвоения образовательных программ. Текущий контроль проводится в течение семестра (опросы, выполнение практических заданий и т.п.).

Промежуточная аттестация проводится по окончании изучения дисциплины в виде **зачета**. Вопросы к промежуточной аттестации сформулированы в **Оценочных и методических материалах**.

10. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины:

а) основная литература:

1. Авдийский, В.И. Теория и практика управления рисками организации: учебник / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных. — М.: КноРус, 2018. — Режим доступа: <http://book.ru/book/926293>
2. Безденежных, В.М. Проектирование систем управления рисками организации: учебник / В.М. Безденежных, В.А. Дадалко, Н.Г. Синявский. — М.: КноРус, 2019. — Режим доступа: <http://book.ru/book/930212>
3. Герасимов, А.Н. Оценка и анализ рисков: учебник / А.Н. Герасимов. — М.: КноРус, 2019. — Режим доступа: <http://book.ru/book/930003>

б) дополнительная литература:

4. Воробьев, С. Н. Управление рисками в предпринимательстве: монография / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - М. Дашков и К', 2006 - 2008

5. Гончаренко, Л. П. Риск-менеджмент: учебное пособие / Л. П. Гончаренко, С. А. Филин. - М.: КноРус, 2010. - Режим доступа: <http://www.book.ru/book/259895>
6. Данилина, М.В. Риски: анализ и оценка: учебное пособие / М.В. Данилина, К.Ю. Багратуни. — М.: Русайнс, 2016. — Режим доступа: <http://book.ru/book/921913>
7. Управление рисками приоритетных инвестиционных проектов. Концепция и методология: монография / В.Г. Антонов [и др.]. — М.: Русайнс, 2016. — Режим доступа: <http://book.ru/book/927793>
8. Черняк, В.З. Принципы управления инновационными рисками на разных стадиях проекта: монография. - М: Русайнс, 2018. — Режим доступа: <https://www.book.ru/book/926706>
9. Шапкин А.С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: учебник / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - М.: Дашков и К', 2006.
10. Чертыковцев, В. К. Математическая теория рисков в социально-экономической сфере: учебник для вузов / В. К. Чертыковцев. — Москва: Юрайт, 2022. — 104 с. — (Высшее образование). — Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/497032>

в) периодические издания открытого доступа

1. Риск-Менеджмент. Практика: деловой журнал / ООО ИД «Реальная экономика». - Архив номеров. - Режим доступа: www.jsdrm.ru
2. Управление финансовыми рисками: практический журнал. – Архив номеров. – ISSN 2221-7541. – Режим доступа: <https://grebennikon.ru/journal-23>

г) Лицензионное программное обеспечение

1. Семейство программ Microsoft Office Standart Russian (Включает набор продуктов: Word, Excel, PowerPoint, Publisher, Outlook);
2. Mirapolis Virtual Room;

Обеспечено доступом к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде СПбГУП.

д) современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Официальный сайт СПбГУП: <http://www.gup.ru/>
2. Электронно-библиотечная система СПбГУП: <http://library.gup.ru>
3. Системы поддержки самостоятельной работы СПбГУП: <http://edu.gup.ru/>
4. Справочная правовая система «Консультант плюс» <http://www.consultant.ru>
5. Российское образование <http://www.edu.ru/>
6. Единое окно доступа к образовательным ресурсам <http://window.edu.ru/>
7. Электронно-библиотечная система «Юрайт» - www.urait.ru
8. Электронно-библиотечная система «Лань» - www.e.lanbook.com
9. Электронно-библиотечная система «Айбукс» - www.ibooks.ru
10. Электронно-библиотечная система «BOOK» - www.book.ru
11. Электронно-библиотечная система «IPRBooks» - www.iprbooks.ru

11. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Аудиторный фонд с демонстрационным оборудованием и техническими средствами обучения (компьютер преподавателя, камера, наушники с гарнитурой, проектор, колонки, экран), учебно-наглядные пособия и методические ресурсы кафедры, фонды Научной библиотеки.

Изучение дисциплины инвалидами и обучающимися с ограниченными возможностями здоровья осуществляется с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья обучающихся.

Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

1. Методические рекомендации по организации самостоятельной работы студентов

Важнейшим методическим приемом в учебном процессе является самостоятельная работа студента. В современных условиях дидактическое значение самостоятельной подготовки неизмеримо возрастает, а ее цели состоят в том, чтобы:

- повысить ответственность самих обучаемых за свою профессиональную подготовку, сформировать в себе личностные и профессионально-деловые качества;
- научить студентов самостоятельно приобретать знания, формировать навыки и умения, необходимые для юридической деятельности;
- развивать в себе самостоятельность в организации, планировании и выполнении заданий, определяемых учебным планом и указаниями преподавателя.

Достигнуть этих целей в ходе самостоятельной работы при изучении дисциплины возможно только при хорошей личной организации своего учебного труда, умении использовать все резервы имеющегося времени и подчинить их профессиональной подготовке.

Самостоятельная работа в процессе изучения дисциплины «Управление проектными рисками» включает в себя:

- изучение обязательной литературы в соответствии с программой дисциплины;
- ознакомление с литературой, рекомендованной в качестве дополнительной;
- сбор материала для написания рефератов (для студентов, имеющих пропуски аудиторных занятий), контрольной работы (для студентов заочной формы обучения), выполнения самостоятельных и практических заданий;
- подготовка докладов, сообщений, электронных презентаций.

Основными компонентами содержания данного вида работы являются:

- творческое изучение учебных пособий и научной литературы;
- умелое конспектирование лекционного материала;
- участие в различных формах учебного процесса (лекции, опрос, дискуссии, выполнение аудиторных практических заданий, выполнение самостоятельных работ, тестирование и самотестирование и т. д.);
- получение консультаций у преподавателя по отдельным проблемам курса;
- знакомство с экономической литературой и информационными ресурсами Интернета и др.

2. Методические рекомендации по подготовке к семинарским занятиям

Семинарские занятия — важная форма учебного процесса. Они способствуют закреплению и углублению знаний, полученных студентами на лекциях и в результате самостоятельной работы над научной и учебной литературой и нормативными источниками. Они призваны развивать самостоятельность мышления, умение делать выводы, связывать теоретические положения с практикой, формировать профессиональное правовое сознание будущих юристов-практиков. На занятиях вырабатываются необходимые каждому юристу навыки и умения публично выступать, логика доказывания, культура профессиональной речи. Кроме того, семинары — это средство контроля преподавателей за самостоятельной работой студентов, они непосредственно влияют на уровень подготовки к итоговым формам отчетности — зачетам и экзаменам. В выступлении на семинарском занятии должны содержаться следующие элементы:

- четкое формулирование соответствующего теоретического положения в виде развернутого определения;
- приведение и раскрытие основных черт, признаков, значения и роли изучаемого явления или доказательства определенного теоретического положения;
- подкрепление теоретических положений конкретными фактами.

Для качественного и эффективного изучения специальности необходимо овладение навыками работы с книгой, воспитание в себе стремления и привычки получать новые знания из научной и иной специальной литературы. Без этих качеств не может быть настоящего специалиста ни в одной области деятельности.

Читать и изучать, следует, прежде всего, то, что рекомендуется к каждой теме программой, планом семинарских занятий, перечнем рекомендуемой литературы.

Когда студент приступает к самостоятельной работе, то он должен проявить инициативу в поиске специальных источников. Многие новейшие научные положения появляются, прежде всего, в статьях, опубликованных в журналах.

Надо иметь в виду, что в каждом последнем номере издаваемых журналов публикуется библиография всех статей, напечатанных за год, это облегчает поиск нужных научных публикаций.

Работа с научной литературой, в конечном счете, должна привести к выработке у студента умения самостоятельно размышлять о предмете и объекте изучения, которое должно проявляться:

- в ясном и отчетливом понимании основных понятий и суждений, содержащихся в публикации, разработке доказательств, подтверждающих истинность тех или иных положений;
- в понимании студентами обоснованности и целесообразности, приводимых в книге и статье примеров, поясняющих доказательства и выводы автора. При этом будет уместно, если студент самостоятельно приведет дополнительные примеры к этим выводам;
- в отделении основных положений от дополнительных, второстепенных сведений;
- в способности студента критически разобраться в содержании публикации, определить свое отношение к ней в целом, дать ей общую оценку, характеристику.

Содержание практических (семинарских) занятий по темам

Тема 1. Риск как экономическая категория

Задание для самостоятельной работы: ознакомиться с электронным курсом по данной дисциплине, прочитать соответствующие разделы рекомендуемой литературы, знать специальную терминологию по теме, подготовить доклад (сообщение)

Контрольные вопросы по теме (для подготовки к опросу):

1. Понятие риска.
2. Виды рисков
3. Классификационные признаки проектных финансовых рисков
4. Особенности управления различными видами проектных рисков.

Тематика докладов (сообщений);

1. Понятие и сущность риска.
2. Основные подходы к определению риска.
3. Особенности риска как экономической категории. 4. Соотношение понятия риска и неопределенности. 5. Классификация рисков.
6. Проектный риск в системе предпринимательских рисков. 7. Характеристика методов управления проектными рисками.

Тема 2. Система риск-менеджмента

Задание для самостоятельной работы: ознакомиться с электронным курсом по данной дисциплине, прочитать соответствующие разделы рекомендуемой литературы, знать специальную терминологию по теме, подготовить доклад (сообщение)

Контрольные вопросы по теме (для подготовки к опросу):

1. Понятие риска.
2. Виды рисков
3. Классификационные признаки проектных финансовых рисков
4. Особенности управления различными видами проектных рисков.

Тематика докладов (сообщений):

1. Понятие и сущность риска.
2. Основные подходы к определению риска.
3. Особенности риска как экономической категории. 4. Соотношение понятия риска и неопределенности. 5. Классификация рисков.
6. Проектный риск в системе предпринимательских рисков. 7. Характеристика методов управления проектными рисками.

Тема 3. Оценка и управление рыночными рисками

Задание для самостоятельной работы: ознакомиться с электронным курсом по данной дисциплине, прочитать соответствующие разделы рекомендуемой литературы, знать специальную терминологию по теме, подготовить доклад (сообщение), подготовиться к решению задач

Контрольные вопросы по теме (для подготовки к опросу):

1. Виды рыночных рисков и их особенности.
2. Оценка риска доходности ценной бумаги и портфеля.
3. Модель оценки капитальных активов.
4. Показатели чувствительности производных ценных бумаг.

Тематика докладов (сообщений):

1. Понятие и виды рыночных рисков.
2. Показатели оценки рыночного риска.
3. Модель оценки капитальных активов.
4. Дюрация и чувствительность. Показатели оценки чувствительности производных ценных бумаг.
5. Оценка риска доходности портфеля ценных бумаг.
6. Особенности применения хеджирования для целей снижения рыночных рисков.

Тема 4. Показатель VaR и методы его оценки

Задание для самостоятельной работы: ознакомиться с электронным курсом по данной дисциплине, прочитать соответствующие разделы рекомендуемой литературы, знать специальную терминологию по теме, подготовиться к опросу и к решению ситуационных задач

Контрольные вопросы по теме (для подготовки к опросу):

1. Сущность и особенности показателя Value at risk.
2. Расчет Value at risk дельта-нормальным методом.
3. Расчет Value at risk методом исторического моделирования.
4. Расчет Value at risk на основе Рискметрик банка J.P. Morgan

Тема 5. Оценка и управление кредитными рисками

Задание для самостоятельной работы: ознакомиться с электронным курсом по данной дисциплине, прочитать соответствующие разделы рекомендуемой литературы, знать специальную терминологию по теме, подготовить доклад (сообщение, эссе), подготовиться к решению ситуационных задач

Контрольные вопросы по теме (для подготовки к опросу):

1. Особенности оценки кредитного риска заемщика.
2. Методы оценки вероятности дефолта.
3. Модели управления кредитным риском портфеля.
4. Применение рейтинговых оценок для управления кредитным риском.

Тематика докладов (сообщений), эссе;

1. Кредитное событие: сущность и виды.
2. Внешние и внутренние кредитные рейтинги.
3. Классификация моделей оценки кредитного риска. Модели оценки кредитоспособности заемщика.
4. Методы оценки дефолта контрагента.

5. Модели оценки кредитного риска портфеля. 6. Подверженность кредитному риску и уровень возмещения потерь.
7. Методы управления кредитным риском.

Тема 6. Оценка суверенного риска

Задание для самостоятельной работы: ознакомиться с электронным курсом по данной дисциплине, прочитать соответствующие разделы рекомендуемой литературы, знать специальную терминологию по теме, подготовить доклад (сообщение)

Контрольные вопросы по теме (для подготовки к опросу):

1. Рейтинговая система США.
2. Рейтинговая система стран Евросоюза.
3. Рейтинговая система Японии.

Тематика докладов (сообщений):

1. Понятие суверенного риска и его составляющие.
2. Система факторов суверенного риска.
3. Взаимосвязь суверенного риска с другими финансовыми рисками.
4. Показатели оценки суверенного риска.
5. Рейтинговые системы стран.

Тема 7. Оценка и управление риском ликвидности

Задание для самостоятельной работы: ознакомиться с электронным курсом по данной дисциплине, прочитать соответствующие разделы рекомендуемой литературы, знать специальную терминологию по теме, подготовить эссе, подготовиться к решению ситуационных задач.

Контрольные вопросы по теме (для подготовки к опросу):

1. Сущность и понятие риска ликвидности.
2. Управление ликвидностью на основе метода разрывов.
3. Расчет показателей оценки ликвидности и ее риска.
4. Управление риском ликвидности портфеля ценных бумаг.

Тематика эссе

1. Понятие и структура риска ликвидности.
2. Механизм управления риском ликвидности.
3. Ликвидность фондового рынка и ее составляющие.
4. Оценка риска ликвидности актива и портфеля активов.
5. Подходы Банка России к оценке балансовой ликвидности коммерческого банка.

Тема 8. Оценка и управление операционными рисками

Задание для самостоятельной работы: ознакомиться с электронным курсом по данной дисциплине, прочитать соответствующие разделы рекомендуемой литературы, знать специальную терминологию по теме, подготовить эссе, подготовиться к решению ситуационных задач.

Контрольные вопросы по теме (для подготовки к опросу):

1. Понятие и виды операционного риска.
2. Анализ волатильности доходов.
3. Индикаторы деятельности компании.
4. Система внутреннего контроля.

Тематика эссе

1. Понятие и проблемы управления операционными рисками.
2. Подходы и способы управления операционными рисками.
3. Особенности принятия решений в условиях неопределенности и риска.
4. Методы оценки и управления операционным риском, предложенные в Новом Базельском соглашении по капиталу.
5. Порядок расчета размера операционного риска по методике Банка России.

Оценочные и методические материалы

Оценочные и методические материалы включают в себя:

- перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы;
- показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания;
- типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы;
- методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

№ п/п	Контролируемые темы дисциплины	Код формируемой компетенции	Код и наименование индикатора достижения	Наименование оценочного средства
1	Риск как экономическая категория	ПК-3	ПК-3.1. <i>Знает</i> понятие, сущность и виды рисков,	Контрольные вопросы по теме, тематика докладов (сообщений)
2	Система риск-менеджмента	ПК-3	ПК-3.1. <i>Знает</i> понятие, сущность и виды рисков, особенности проектного риска; теоретические основы риск-менеджмента ПК-3.3. <i>Владеет</i> методами оценки различных видов рисков; навыками анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений	Контрольные вопросы по теме, тематика докладов (сообщений), тематика эссе
3	Оценка и управление рыночными рисками	ПК-3	ПК-3.1. <i>Знает</i> понятие, сущность и виды рисков, особенности проектного риска; теоретические основы риск-менеджмента; особенности оценки и управления рыночными рисками. ПК-3.2. <i>Умеет</i> количественно оценивать рыночные риски ПК-3.3. <i>Владеет</i> методами оценки различных видов рисков; навыками анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений	Контрольные вопросы по теме, тематика докладов (сообщений), виды практических и тестовых заданий
4	Показатель VaR и методы его оценки	ПК-3	ПК-3.1. <i>Знает</i> понятие, сущность и виды рисков, особенности проектного риска; теоретические основы риск-менеджмента; особенности оценки и управления рыночными рисками; понятие и сущность показателя Value at risk (VaR) и методы его оценки ПК-3.2. <i>Умеет</i> количественно оценивать различные виды проектных рисков ПК-3.3. <i>Владеет</i> методами оценки различных видов рисков; навыками анализа рыночных и	Контрольные вопросы по теме, тематика докладов (сообщений), виды практических

			специфических рисков для принятия управленческих решений	заданий
5	Оценка и управление кредитными рисками	ПК-3	<p>ПК-3.1. <i>Знает</i> понятие, сущность и виды рисков, особенности проектного риска; теоретические основы риск-менеджмента; особенности оценки и управления рыночными рисками; понятие и сущность показателя Value at risk (VaR) и методы его оценки; особенности оценки и управления кредитными рисками</p> <p>ПК-3.2. <i>Умеет</i> количественно оценивать различные виды проектных рисков: рыночных, кредитных</p> <p>ПК-3.3. <i>Владеет</i> методами оценки различных видов рисков; навыками анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений</p>	Контрольные вопросы по теме, тематика докладов (сообщений), виды практических и тестовых заданий
6	Оценка суверенного риска	ПК-3	<p>ПК-3.1. <i>Знает</i> понятие, сущность и виды рисков, особенности проектного риска; теоретические основы риск-менеджмента; особенности оценки и управления рыночными рисками; понятие и сущность показателя Value at risk (VaR) и методы его оценки; особенности оценки и управления кредитными рисками; методы оценки суверенного риска</p> <p>ПК-3.2. <i>Умеет</i> количественно оценивать различные виды проектных рисков: рыночных, кредитных, суверенных</p> <p>ПК-3.3. <i>Владеет</i> методами оценки различных видов рисков; навыками анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений</p>	Контрольные вопросы по теме, тематика докладов (сообщений)
7	Оценка и управление риском ликвидности	ПК-3	<p>ПК-3.1. <i>Знает</i> понятие, сущность и виды рисков, особенности проектного риска; теоретические основы риск-менеджмента; особенности оценки и управления рыночными рисками; понятие и сущность показателя Value at risk (VaR) и методы его оценки; особенности оценки и управления кредитными рисками; методы оценки суверенного риска; механизм управления риском ликвидности;</p> <p>ПК-3.2. <i>Умеет</i> количественно оценивать различные виды проектных рисков: рыночных, кредитных, суверенных, рисков ликвидности,</p> <p>ПК-3.3. <i>Владеет</i> методами оценки различных видов рисков; навыками анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений</p>	Контрольные вопросы по теме, виды практических и тестовых заданий
8	Оценка и управление операционными рисками	ПК-3	<p>ПК-3.1. <i>Знает</i> понятие, сущность и виды рисков, особенности проектного риска; теоретические основы риск-менеджмента; особенности оценки и управления рыночными рисками; понятие и сущность показателя Value at risk (VaR) и методы его оценки; особенности оценки и управления кредитными рисками; методы оценки суверенного риска; механизм управления риском ликвидности; подходы и способы управления операционными рисками.</p> <p>ПК-3.2. <i>Умеет</i> количественно оценивать различные виды проектных рисков: рыночных, кредитных, суверенных, рисков ликвидности, операционных рисков.</p> <p>ПК-3.3. <i>Владеет</i> методами оценки различных</p>	Контрольные вопросы по теме, виды практических и тестовых заданий

			видов рисков; навыками анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений	
Результат достижения планируемых результатов изучения дисциплины				Зачет

2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций, шкал оценивания

Критерии оценивания (текущий контроль)

1. Оценка «отлично» выставляется студенту, если студент имеет глубокие знания учебного материала по теме практического задания, в логической последовательности излагает материал; смог ответить на все уточняющие и дополнительные вопросы;
2. Оценка «хорошо» выставляется, если студент показал знание учебного материала, смог ответить почти полностью на все заданные дополнительные и уточняющие вопросы;
3. Оценка «удовлетворительно» выставляется, если студент в целом освоил материал; однако, ответил не на все уточняющие и дополнительные вопросы;
4. Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, если он имеет существенные пробелы в знаниях основного учебного материала по теме практического задания, который полностью не раскрыл содержание вопросов, не смог ответить на уточняющие и дополнительные вопросы.

Критерии оценивания (зачет)

Знания, умения, навыки и компетенции студентов оцениваются следующими оценками: «зачтено», «не зачтено».

- «зачтено» - студент хорошо и прочно усвоил весь программный материал, исчерпывающе, последовательно, грамотно и логически стройно его излагает, увязывает с практикой, свободно справляется с решением ситуационных задач и тестовыми заданиями, правильно обосновывает принятие решений, умеет самостоятельно обобщать программный материал, не допуская ошибок, знает дополнительную литературу по изучаемой дисциплине.

- «не зачтено» - студент не знает значительной части основного программного материала, в ответах допускает существенные ошибки, не владеет умениями и навыками в выполнении тестовых заданий и решении задач, не способен ответить на дополнительные вопросы.

3. Типовые контрольные задания и методические материалы, процедуры оценивания знаний, умений и навыков

ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ

Примерная тематика докладов (сообщений):

1. Развитие теории риска в процессе эволюции экономической мысли.
2. Риск как объект управления предприятием.
3. Классификация рисков предприятия.
4. Сущность, цель и задачи управления рисками предприятия.
5. Функции и механизм управления рисками предприятия.
6. Содержание процесса управления рисками предприятия.
7. Система информационного обеспечения управления рисками предприятия.
8. Система риск-анализа проектной деятельности предприятия.
9. Система риск-планирования проектной деятельности предприятия.
10. Система риск-контроллинга проектной деятельности предприятия.

11. Методика оценки уровня риска.
12. Методы оценки фактора инфляции в процессе управления рисками.
13. Методика оценки фактора ликвидности в процессе управления рисками.
14. Методы обоснования управленческих решений в условиях риска и неопределенности.
15. Понятие конъюнктуры финансового рынка и методические подходы к ее исследованию.
16. Исследование конъюнктуры финансового рынка методами технического анализа.
17. Исследование конъюнктуры финансового рынка методами фундаментального анализа.
18. Анализ системы финансовых инструментов, используемых предприятием.
19. Избежание и лимитирование финансовых рисков предприятия.
20. Хеджирование финансовых рисков предприятия с использованием производных ценных бумаг.
21. Диверсификация, трансферт и самострахование рисков предприятия.
22. Сущность и виды страхования рисков предприятия.
23. Моделирование оценки эффективности передачи финансового риска предприятия страховщику.
24. Управление риском снижения финансовой устойчивости предприятия.
25. Управление риском неплатежеспособности предприятия.
26. Управление кредитным риском предприятия.
27. Управление проектными рисками предприятия.
28. Управление рисками финансовых инструментов инвестирования.
29. Сущность и задачи антикризисного финансового управления предприятием.
30. Внутренние механизмы финансовой стабилизации предприятия.

Требования:

1. Доклад представляется студентом в письменном виде и должен иметь объем не менее 3-5 страниц машинописного текста, список использованной литературы и других информационных источников должен составлять не менее пяти наименований. Доклад должен иметь титульный лист, на котором указывается название дисциплины, тема и фамилия студента с указанием номера группы. Содержательная часть доклада должна быть сгруппирована в разделы, их количество зависит от выбранной темы и наличия конкретного материала. Доклад должен содержать выводы, самостоятельно сделанные студентом на основе рассмотренного материала по теме (особенно актуально для тем, имеющих дискуссионную направленность). Доклад может быть представлен преподавателю без обязательного озвучивания на семинаре (по желанию студента).
2. Сообщение - готовится студентом в устной форме и носит сугубо информационный характер продолжительностью не менее 5 минут. Ссылка на источник информации – обязательна.

Темы рефератов

(для студентов, имеющих пропуски семинарских занятий или желающих повысить текущую успеваемость)

1. Развитие теории риска в процессе эволюции экономической мысли.
2. Риск как объект управления.
3. Место финансовых рисков в системе рисков предприятия.
4. Информационное обеспечение управления финансовыми рисками.
5. Риск-контроллинг финансовой деятельности предприятия.
6. Инструменты оценки уровня риска.
7. Обоснование управленческих решений в условиях риска и неопределенности.
8. Конъюнктура финансового рынка и методы ее исследования.
9. Технический анализ как метод исследования конъюнктуры финансового рынка.
10. Фундаментальный анализ как метод исследования конъюнктуры финансового рынка.

11. Финансовая политика предприятия как фактор управления финансовыми рисками.
12. Избежание и лимитирование финансовых рисков предприятия.
13. Хеджирование финансовых рисков с использованием производных ценных бумаг.
14. Механизмы нейтрализации финансовых рисков.
15. Страхование финансовых рисков предприятия.
16. Использование модели Хаустона при оценке эффективности страхования финансовых рисков.
17. Управление риском снижения финансовой устойчивости предприятия.
18. Управление риском неплатежеспособности предприятия.
19. Анализ чувствительности инвестиционного проекта.
20. Оценка проектного риска инвестиционного проекта методом «Дерева решений».
21. Оценка проектного риска инвестиционного проекта методом имитационного моделирования.
22. Оценка проектного риска инвестиционного проекта при помощи анализа сценариев проекта.
23. Понятие «инвестиционный портфель». Принципы формирования инвестиционного портфеля.
24. Методы диагностики финансового кризиса предприятия.
25. Внутренние механизмы финансовой стабилизации предприятия в системе управления финансовыми рисками.
26. Модели определения цен основных активов при формировании инвестиционного портфеля.
27. Личностные факторы и их влияние на степень финансового риска предприятия.
28. Критерии оптимальности в условиях полной неопределенности.
29. Методы вероятностной оценки уровня финансового риска.
30. Инвестиционный портфель: понятие и методы формирования.

Требования:

- 1) Из имеющегося списка тем студент выбирает ту, которая по своему содержанию соответствует пропущенному занятию, и должен раскрыть в реферате основные положения рассматриваемого вопроса, используя материалы лекций, литературу по данной теме и дополнительную информацию из любого другого источника, включая Интернет.
- 2) Реферат должен иметь объем не менее десяти страниц машинописного текста, список использованной литературы и других информационных источников должен составлять не менее пяти наименований. Реферат должен иметь титульный лист, на котором указывается название дисциплины, тема реферата и фамилия студента с указанием номера группы. Содержательная часть реферата должна быть сгруппирована в разделы, их количество зависит от выбранной темы и наличия конкретного материала. Реферат должен содержать выводы, самостоятельно сделанные студентом на основе рассмотренного материала по теме.

Примеры самостоятельных практических заданий (тематика эссе)

1. Инструменты хеджирования, предлагаемые на российском рынке
2. Тенденции развития рынка срочных контрактов
3. Прогнозы изменения валютных курсов
4. Управление инфляцией и прогнозы темпов роста цен

Другие темы эссе могут быть предложены студентами по согласованию с преподавателем

Объем работ не должен превышать 2-3 страниц машинописного текста, они должны быть оформлены в соответствии с имеющимися в ВУЗе рекомендациями по представлению письменных работ (см требования по написанию контрольной работы). Срок выполнения работы – две недели.

Ситуационные задачи

Задача 1.

Хеджеру надо застраховаться от падения цен на сырую нефть. Какой инструмент ему выбрать и какую стратегию хеджирования применить.

Задача 2.

Хеджеру надо застраховаться от роста цен на бензин, которого у него пока нет. Какой инструмент ему выбрать и какую стратегию хеджирования применить.

Задача 3.

Банк опасается снижения учетной ставки. Какой инструмент ему выбрать и какую стратегию хеджирования применить.

Задача 4.

Спот –цена нефти 105 долл/барр. Фьючерсная цена 104,87 долл/барр. Посчитайте затраты хеджера, если он страхуется на 4 месяца, от падения цены.

Задача 5.

Спот –цена нефти 99 долл/барр. Фьючерсная цена 100,5 долл/барр. Посчитайте затраты хеджера, если он страхуется на 7 месяцев, от роста цены.

Задача 6.

Спот –цена нефти 100 долл/барр. Какой инструмент оптимально выбрать хеджеру, если цена не упадет ниже 80 долл/барр.

Задача 7.

Спот –цена нефти 100 долл/барр. Какой инструмент оптимально выбрать хеджеру, если цена не вырастет выше 150 долл/барр.

Задача 8.

У оператора куплено 100 колл-опционов. Захеджируйте его позицию, если дельта опционов равна 0,34.

Задача 9.

У оператора продано 100 пут-опционов. Захеджируйте его позицию, если дельта опционов равна 0,97.

Задача 10.

У оператора куплено 70 колл-опционов и 30 пут-опционов. Захеджируйте его позицию, если дельта коллов равна 0,2, а дельта путов 0,7.

Тестовые задания

Важными критерием оценки уровня текущих знаний студентов является выполнение ими тестовых заданий по отдельным темам. В частности, тестирование позволяет по мере прохождения учебного материала оценить уровень формирования у студентов необходимых знаний.

Примеры аудиторных тестовых заданий для текущего контроля процесса формирования у студентов необходимых компетенций:

К теме №3

1. Как называют рынок, где поставка актива осуществляется против платежа.

- 1) срочный
- 2) производный
- 3) деривативов
- 4) спот-рынок

2. Какой из финансовых инструментов не является биржевым.

- 1) своп
- 2) фьючерс
- 3) опцион
- 4) опцион на значение фьючерса

К теме №6

1. Изменение процентной ставки вызывает увеличение следующего риска.

- 1) кредитного
- 2) депозитного
- 3) инвестиционного
- 4) процентного

2. Какой метод управления риском требует привлечения дополнительного капитала.

- 1) хеджирование
- 2) распределение рисков
- 3) концентрация риска
- 4) лимитирование

Время тестирования – 10 минут (10 тестовых вопросов).

ПРОМЕЖУТОЧНАЯ АТТЕСТАЦИЯ

Вопросы для подготовки к зачету

1. Понятие и сущность риска.
2. Основные подходы к определению риска.
3. Особенности риска как экономической категории.
4. Соотношение понятия риска и неопределенности.
5. Классификация рисков.
6. Основные виды рисков.
7. Проектный риск в системе предпринимательских рисков.
8. Характеристика методов управления проектными рисками.
9. Организация управления финансовыми рисками на предприятии.
10. Стратегия управления финансовыми рисками.
11. Документальное обеспечение системы управления финансовыми рисками.
12. Функция планирования и контроля в системе риск-менеджмента.
13. Способы построения системы рисков предприятия.
14. Понятие и виды рыночных рисков.
15. Показатели оценки рыночного риска.
16. Модель оценки капитальных активов.
17. Дюрация и чувствительность.
18. Показатели оценки чувствительности производных ценных бумаг.
19. Оценка риска доходности портфеля ценных бумаг.
20. Особенности применения хеджирования для целей снижения рыночных рисков.
21. Понятие и сущность показателя Value at risk (VaR).
22. Преимущества и недостатки показателя VaR.
23. Параметры показателя VaR.
24. Дельта-нормальный метод расчета VaR: сущность, порядок расчета, недостатки и достоинства.
25. Метод исторического моделирования. Метод Монте-Карло. VaR в Рискметриках банка J.P. Morgan.
26. Понятие и виды кредитного риска.
27. Кредитное событие: сущность и виды.
28. Внешние и внутренние кредитные рейтинги.
29. Классификация моделей оценки кредитного риска.
30. Модели оценки кредитоспособности заемщика.
31. Методы оценки дефолта контрагента.
32. Модели оценки кредитного риска портфеля.
33. Подверженность кредитному риску и уровень возмещения потерь.

34. Методы управления кредитным риском.
35. Понятие суверенного риска и его составляющие.
36. Система факторов суверенного риска.
37. Взаимосвязь суверенного риска с другими финансовыми рисками.
38. Показатели оценки суверенного риска.
39. Рейтинговые системы стран.
40. Понятие и структура риска ликвидности.
41. Механизм управления риском ликвидности.
42. Ликвидность фондового рынка и ее составляющие.
43. Оценка риска ликвидности актива и портфеля активов.
44. Подходы Банка России к оценке балансовой ликвидности коммерческого банка.
45. Понятие и виды операционных рисков.
46. Проблемы управления операционными рисками.
47. Подходы и способы управления операционными рисками.
48. Особенности принятия решений в условиях неопределенности и риска.
49. Методы оценки и управления операционным риском, предложенные в Новом Базельском соглашении по капиталу.
50. Порядок расчета размера операционного риска по методике Банка России.

Глоссарий

Архив документов программы - структурированный комплект документации по программе, представленный в бумажном и/или электронном виде.

Архив проекта - структурированный комплект документации проекта, представленный в бумажном и/или электронном виде.

Базовый план проекта - принятый к исполнению план проекта, содержащий сведения об основных временных и стоимостных параметрах проекта.

Бюджет программы - документ, содержащий общую сумму финансовых средств, используемых программой, распределенных по статьям и временным периодам.

Бюджет проекта - документ, содержащий общую сумму финансовых средств, распределенных по статьям и временным периодам.

Выгоды программы - комплекс определенных положительных результатов и/или эффектов, получаемых в ходе выполнения и в результате реализации программы

Допущение - предположение, которое считается верным для компонента портфеля и портфеля в целом без привлечения доказательств.

Заинтересованные стороны в программе - лица или организации, чьи интересы могут быть затронуты в ходе реализации программы.

Заинтересованные стороны в проекте - лица или организации, чьи интересы могут быть затронуты в ходе реализации проекта.

Заинтересованные стороны портфеля проектов - лица или организации, чьи интересы могут быть затронуты в ходе реализации портфеля или отдельных компонентов портфеля.

Изменение в компоненте - изменение утвержденного ранее содержания, сроков, ресурсов в компоненте (проекте, программе), а также установленных процедур управления.

Изменение в программе - изменение утвержденных ранее содержания, сроков, ресурсов, а также установленных процедур управления.

Изменение в проекте - модификация утвержденного ранее содержания, сроков, ресурсов в проекте, а также установленных процедур.

Категоризация - объединение компонентов портфеля в группы на основе установленных критериев.

Компонент портфеля - проект или программа, которые выполняются в рамках портфеля.

Контрольное событие программы - существенное событие программы, отражающее получение измеримых результатов программы или получение запланированных выгод.

Контрольное событие проекта - существенное событие проекта, отражающее получение измеримых результатов проекта.

Корректирующее действие - действие, предпринятое для устранения обнаруженного несоответствия плану.

Ограничение - сдерживающий фактор, влияющий на ход исполнения проекта и/или портфеля в целом, и/или возможность получения выгод программы.

Портфель проектов - набор компонентов, которые группируются вместе с целью эффективного управления и для достижения стратегических целей организации.

Предупреждающее действие - действие, предпринятое для снижения вероятности и/или последствий отрицательных рисков программы, проекта.

Приоритет - степень важности компонента портфеля, установленная в рамках отдельной стратегической категории или всего портфеля проектов.

Приоритизация - ранжирование компонентов портфеля в порядке приоритета на основе установленных показателей.

Программа - совокупность взаимосвязанных проектов и другой деятельности, направленных на достижение общей цели и реализуемых в условиях общих ограничений.

Продукт проекта - измеримый результат, который должен быть получен в ходе реализации проекта.

Проект - комплекс взаимосвязанных мероприятий, направленный на создание уникального продукта или услуги в условиях временных и ресурсных ограничений.

Работа проекта - действие, выполняемое для достижения цели проекта.

Расписание программы (календарный план) - документ, содержащий плановые даты исполнения работ, и контрольных событий программы.

Расписание проекта (календарный план) - плановые даты исполнения работ и контрольных событий проекта.

Риск - вероятное для программы событие, наступление которого может как отрицательно, так и положительно отразиться на результатах и/или выгодах программы, проекта.

Управление проектом - планирование, организация и контроль трудовых, финансовых и материально-технических ресурсов проекта, направленные на эффективное достижение целей проекта.

Методические рекомендации для преподавателя по дисциплине «Управление проектными рисками в СКС»

Управление рисками является неотъемлемой и важной составляющей управления проектами предприятий и предпринимателей. Понимание природы рисков, знание методов их оценки и подходов к управлению ими (снижения их последствий и уменьшения вероятности их наступления) выступает важным фактором эффективности финансово-хозяйственной деятельности в современной экономике.

Цель изучения дисциплины - формирование у студентов теоретических основ и практических навыков управления проектными рисками.

Задачами изучения дисциплины являются:

- освоение студентами методов оценки проектных рисков, в том числе факторов и показателей, характеризующих рискованность различных финансовых вложений;
- рассмотрение возможных подходов к организации и управлению проектными рисками.

Форма промежуточной аттестации – **зачет**

Тема занятия	Виды учебных занятий	Способ учебной деятельности	Методы обучения, формы педагогического общения	Средства обучения	Формы контроля
1	2	5	6	7	8
Риск как экономическая категория	Лекция	Коллективный	<i>метод</i> - объяснительно-иллюстративный <i>форма общения</i> – монолог с элементами диалога	печатные электронные презентации	Устные ответы студентов на вопросы преподавателя по теме (по ходу лекции или в конце занятия)
	семинар	Коллективно-индивидуальный	Дискуссионный метод Формы: - диалог - полилог - индивид. работа	печатные (раздаточный материал)	Опрос, дискуссия, доклады (сообщения).
Система риск-менеджмента	Лекция	Коллективный	<i>метод</i> - объяснительно-иллюстративный <i>форма общения</i> – монолог с элементами диалога	печатные электронные презентации	Устные ответы студентов на вопросы преподавателя по теме (по ходу лекции или в конце занятия)
	семинар	Индивидуальный Коллективный	Форма: выполнение заданий (индивидуально) с последующим обсуждением (коллективно)	печатные (раздаточный материал)	Устный опрос, дискуссия, доклады (сообщения), эссе
Оценка и управление рыночными рисками	Лекция	Коллективный	<i>метод</i> - объяснительно-иллюстративный <i>форма общения</i> – монолог с элементами диалога	печатные электронные презентации	Устные ответы студентов на вопросы преподавателя по теме (по ходу лекции или в конце занятия)
	Семинар	Индивидуальный Коллективный	Форма: выполнение заданий (индивидуально) с последующим обсуждением	печатные (раздаточный материал)	Устный опрос, дискуссия, доклады (сообщения), тестирование, решение задач

			(коллективно)		
Показатель VaR и методы его оценки	Лекция	Коллективный	<i>метод</i> - объяснительно-иллюстративный <i>форма общения</i> – монолог с элементами диалога	печатные электронные презентации	Устные ответы студентов на вопросы преподавателя по теме (по ходу лекции или в конце занятия)
	Семинар	Коллективный Индивидуальный	Форма: выполнение заданий (индивидуально) с последующим обсуждением (коллективно)	печатные (раздаточный материал)	выполнение практических заданий с последующим обсуждением
Оценка и управление кредитными рисками	Лекция	Коллективный	<i>метод</i> - объяснительно-иллюстративный <i>форма общения</i> – монолог с элементами диалога	печатные электронные презентации	Устные ответы студентов на вопросы преподавателя по теме (по ходу лекции или в конце занятия)
	Семинар	Индивидуальный Коллективный	Форма: выполнение заданий (индивидуально) с последующим обсуждением (коллективно)	печатные (раздаточный материал)	доклады (сообщения), выполнение самостоятельного задания, тестирование
Оценка суверенного риска	Лекция	Коллективный	<i>метод</i> - объяснительно-иллюстративный <i>форма общения</i> – монолог с элементами диалога	печатные электронные презентации	Устные ответы студентов на вопросы преподавателя по теме (по ходу лекции или в конце занятия)
	Семинар	Индивидуальный Коллективный	Форма: выполнение заданий (индивидуально) с последующим обсуждением (коллективно)	печатные (раздаточный материал)	Устный опрос, выступление с докладами (сообщениями). Дискуссия
Оценка и управление риском ликвидности	Лекция	Коллективный	<i>метод</i> - объяснительно-иллюстративный <i>форма общения</i> – монолог с элементами диалога	печатные электронные презентации	Устные ответы студентов на вопросы преподавателя по теме (по ходу лекции или в конце занятия)
	Семинар	Коллективный	Дискуссионный метод Формы: - диалог - полилог	печатные электронные презентации	Устный опрос, решение ситуационных задач, выполнение самостоятельного задания.
Оценка и управление операционными рисками	Лекция	Коллективный	<i>метод</i> - объяснительно-иллюстративный <i>форма общения</i> – монолог с элементами диалога	печатные электронные презентации	Устные ответы студентов на вопросы преподавателя по теме (по ходу лекции или в конце занятия)

	Семинар	Индивидуальный Коллективный	Форма: выполнение заданий (индивидуально) с последующим обсуждением (коллективно)	печатные (раздаточный материал)	Устный опрос, решение ситуационных задач, выполнение самостоятельного задания.
--	---------	--------------------------------	---	---------------------------------	--

Тематический план изучения дисциплины «Управление проектными рисками в СКС»

Год набора: **2022**

Форма обучения - **очная**

Наименование разделов и тем	Всего	Трудоемкость по дисциплине					Формируемые компетенции
		контакт. работа	в т.ч.			СРС	
			лекции	лаб. работы	практ. / сем		
Риск как экономическая категория	22	4	2		2	18	ПК-3
Система риск-менеджмента	22	4	2		2	18	ПК-3
Оценка и управление рыночными рисками	24	6	2		4	18	ПК-3
Показатель VaR и методы его оценки	22	4	2		2	18	ПК-3
Оценка и управление кредитными рисками	26	8	4		4	18	ПК-3
Оценка суверенного риска	26	8	4		4	18	ПК-3
Оценка и управление риском ликвидности	26	8	4		4	18	ПК-3
Оценка и управление операционными рисками	26	8	4		4	18	ПК-3
Итого по дисциплине	180	50	24		26	94	
Зачетных единиц	5						