

**Автономная некоммерческая организация высшего образования  
"Открытый университет экономики, управления и права"  
(АНО ВО ОУЭП)**

**УТВЕРЖДАЮ:**  
Ректор АНО ВО ОУЭП, Фокина В.Н.



19 апреля 2023 г.

Решение Ученого совета АНО ВО ОУЭП,  
Протокол № 9 от 19.04.2023 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

**по дисциплине**

Наименование дисциплины Б1.В.03 «Управление рисками в организации»  
Образовательная программа направления подготовки 38.04.01 «Экономика»,  
Направленность (профиль): Экономика фирмы

Квалификация - магистр

**Разработчик:**  
Шипкова О.Т., к.э.н., доц.

Москва 2023

### 1. Цели и задачи дисциплины

**Цель дисциплины** является изучение особенностей рисков, а также экономических основ управления различными их видами для снижения финансовых потерь и обеспечения условий успешного функционирования компании.

#### **Задачи дисциплины:**

- детальное изучение сущности и видов экономических рисков, выявление причин возникновения каждого вида рисков;
- исследование сферы возникновения чистых и спекулятивных, в т.ч. финансовых рисков;
- освоение стратегических и тактических приемов управления различными видами рисков, а также возможности их сочетания.

### 2 Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина «Управление рисками в организации» относится к дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений.

### 3 Планируемые результаты обучения по дисциплине

В результате изучения дисциплины обучающийся должен освоить:

#### **универсальную компетенцию**

УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий

#### **профессиональную компетенцию**

ПК-3 Способен разрабатывать методики и оценивать эффективность экономических проектов с учетом факторов риска в условиях неопределенности

#### **Результаты освоения дисциплины, установленные индикаторы достижения компетенций**

Наименование компетенции	Индикаторы достижений компетенции	Показатели (планируемые) результаты обучения
УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	УК-1.1. Анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними;	<b>Знать:</b> <ul style="list-style-type: none"><li>• основы теории риска;</li><li>• основы системного подхода;</li><li>•</li></ul>
	УК-1.2. Осуществляет поиск алгоритмов решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации. Определяет в рамках выбранного алгоритма вопросы (задачи), подлежащие дальнейшей детальной разработке. Предлагает способы их решения.	<b>Уметь</b> <ul style="list-style-type: none"><li>• выполнять комплексы расчетов на ЭВМ в пакете Microsoft Excel;</li><li>• анализировать проблемную ситуацию;</li><li>• анализировать информацию из доступных источников.</li></ul>
		<b>Владеть:</b> <ul style="list-style-type: none"><li>• навыками решения поставленной проблемной ситуации на основе доступных источников информации;</li><li>• обработки информации и поиска решения.</li></ul>
ПК-3 Способен разрабатывать методики и оценивать эффективность экономических проектов с учетом факторов риска в условиях неопределенности	ПК-3.3. Демонстрирует знание методов анализа и оценки риска, владеет принципами соотношения риска и доходности; обосновывает перспективы выбора методов оценки рисков, разрабатывает алгоритмы управления рисками.	<b>Знать:</b> <ul style="list-style-type: none"><li>• специфику и особенности оценки управления рисками в реальном секторе экономики;</li><li>• методы оценки эффективности экономических проектов</li></ul>
	ПК-3.4. Формирует и применяет методики оценки эффективности экономических проектов в условиях неопределенности; демонстрирует навыки формулирования выводов на основе проведенного исследования для принятия	<b>Уметь</b> <ul style="list-style-type: none"><li>• формировать необходимую исходную информацию для оценки риска и обоснования управления рисками;</li><li>• обосновывать перспективы выбора методов оценки рисков;</li><li>• разрабатывать алгоритмы</li></ul>

Наименование компетенции	Индикаторы достижений компетенции	Показатели (планируемые) результаты обучения
	управленческих решений о реализации экономических проектов в виде методик и аналитических материалов.	управления рисками <b>Владеть:</b> <ul style="list-style-type: none"> <li>• методами анализа и управления рисками в реальном секторе экономики;</li> <li>• методикой оценки эффективности экономических проектов в условиях неопределенности;</li> <li>• навыками классификации рисков.</li> </ul>

Знания, умения и навыки, формируемые дисциплиной «Управление рисками в организации», являются необходимыми для изучения последующих дисциплин .

#### Междисциплинарные связи с дисциплинами

Компетенция	Этапы формирования компетенций, определяемые дисциплинами направления подготовки «Экономика»			
	начальный	последующий	итоговый	
<b>УК-1</b> Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	Экономический анализ и аудит	Методология научных исследований	История экономической мысли	
	Финансовый менеджмент (продвинутый уровень)	Информационные технологии в экономике	Логика и аргументация в научной дискуссии	
	Учебная практика: научно-исследовательская работа (получение первичных навыков научно-исследовательской работы)	Управление рисками в организации	Производственная практика: научно-исследовательская работа	Производственная практика: научно-исследовательская работа
			Производственная практика: научно-исследовательская работа	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы
<b>ПК-3</b> Способен разрабатывать стратегии развития и функционирования фирмы с целью адаптации ее деятельности и системы управления к изменяющимся в условиях рынка внешним и внутренним экономическим условиям	Налоговое планирование	Организация бухгалтерского и управленческого учета на предприятии	Оценка и развитие бизнеса	
		Корпоративные финансы (продвинутый уровень)	Антикризисное управление (продвинутый уровень)	
		Производственная практика: практика по профилю профессиональной деятельности	Производственная практика: научно-исследовательская работа	
		Производственная практика: научно-исследовательская работа	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы	

#### 4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды работы по дисциплине :

№ п/п	Виды учебных занятий	Всего часов по формам обучения, ак. ч			
		Очная		Заочная	
		всего	в том числе	всего	в том числе
<b>1</b>	<b>Контактная работа (объем работы обучающихся во взаимодействии с преподавателем) (всего)</b>			<b>10,2</b>	
	<i>В том числе в форме практической подготовки</i>				2
1.1	занятия лекционного типа (лекции)			2	

1.2	занятия семинарского типа (практические)*, в том числе:			6	
1.2.1	семинар-дискуссия, практические занятия, <i>в том числе в форме практической подготовки</i>				0 6 2
1.2.2	занятия семинарского типа: лабораторные работы (лабораторные практикумы)				
1.2.3	курсовое проектирование (выполнение курсовой работы)				
1.3	контроль промежуточной аттестации и оценивание ее результатов, в том числе:			2,2	
1.3.1	консультации групповые				2
1.3.2	прохождение промежуточной аттестации				0,2
<b>2</b>	<b>Самостоятельная работа (всего)</b>			91	
2.1	работа в электронной информационно- образовательной среде с образовательными ресурсами учебной библиотеки, компьютерными средствами обучения для подготовки к текущему контролю успеваемости и промежуточной аттестации, к курсовому проектированию (выполнению курсовых работ)			<b>91</b>	
2.2	самостоятельная работа при подготовке к промежуточной аттестации			<b>6,8</b>	
<b>3</b>	<b>Общая трудоемкость</b> часы <b>дисциплины</b> зачетные единицы форма промежуточной аттестации			<b>108</b> 3	
					ЭКЗАМЕН

\*

Семинар – семинар-дискуссия

ГТ - практическое занятие - глоссарный тренинг

ТТ - практическое занятие - тест-тренинг

ПЗТ - практическое занятие - позовое тестирование

ЛС - практическое занятие - логическая схема

УД - семинар - обсуждение устного доклада

РФ – семинар - обсуждение реферата

Ассесмент реферата - семинар-ассесмент реферата

ВБ - вебинар

УЭ - семинар - обсуждение устного эссе

КР - курсовое проектирование (работа)

ЛАБ - лабораторная работа (лабораторный практикум)

АЛТ - практическое занятие - алгоритмический тренинг

## 5. Содержание дисциплины

### 5.1. Содержание разделов и тем

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела дисциплины
1	Основы теории принятия рискованных решений	Неопределенность и риск. Особенности принятия решений в условиях неопределенности будущих результатов. Определение риска на основе неопределенных будущих результатов. Риски бизнеса в реальном секторе экономики. Основные проблемы управления рисками в реальном бизнесе. Факторы риска. Основные разновидности факторов риска. Внешние факторы риска. Внутренние факторы риска. Стратегии рискованных решений и основные методы управления рисками. Особенности современной экономики и их влияние на стратегии развития бизнеса. Основные стратегии развития бизнеса и управления рисками. Основные методы управления рисками.
2	Методы учета риска при обосновании долгосрочных проектов материальных	Анализ чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Анализ чувствительности как метод оценки устойчивости инвестиционного проекта. Аналитический подход к анализу чувствительности. Дискретный анализ чувствительности. Метод Монте-Карло. Измерение риска долгосрочных инвестиционных проектов. Основные меры риска долгосрочного инвестиционного

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела дисциплины
	инвестиций	проекта. Оценка риска долгосрочного инвестиционного проекта на основе дерева событий. Оценка риска по методу сценариев будущего развития. Использование дерева решений при оценке риска инвестиционных проектов.
3	Управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта	Оперативное управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта. Основные особенности организации управления риском. Управление риском на основе досрочного прекращения проекта. Оперативное управление риском на основе увеличения расходов на рекламу. Управление риском с помощью диверсификации. Диверсификация на основе производства взаимозаменяемых товаров. Диверсификация на основе производства взаимодополняемых товаров. Проекты с независимыми доходами. Управление рисками проектов долгосрочных инвестиций с помощью реальных опционов. Реальные опционы: определения, виды и характеристики. Использование простых реальных опционов для управления рисками. Комбинированные реальные опционы. Встроенный реальный опцион на развитие бизнеса. Влияние реальных опционов на оценку инвестиций и стоимость рискованных активов капитала. Управление рисками с помощью стратегий смешанного типа на основе реальных опционов. Использование комбинаций реальных опционов для управления рисками инвестиционных проектов. Некоторые возможности формирования решений смешанного типа по управлению рисками. Управление рисками в условиях использования лизинга. Некоторые особенности лизинговых контрактов. Обоснование условий лизинга. Управление рисками с помощью реальных опционов, встроенных в лизинговый контракт.

## 5.2 Занятия лекционного и семинарского типа

### 5.2.1 Темы лекций

#### Раздел 1. Основы теории принятия рискованных решений

1. Основные проблемы управления рисками в реальном бизнесе. Основные методы управления рисками.

#### Раздел 2. Методы учета риска при обосновании долгосрочных проектов материальных инвестиций.

1. Анализ чувствительности проектов долгосрочных инвестиций. Измерение риска долгосрочных инвестиционных проектов.

#### Раздел 3. Управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта.

1. Основные особенности организации управления риском. Управление рисками в условиях использования лизинга.

### 5.2.2 Вопросы для обсуждения на семинарах и практических занятиях

#### Раздел 1. Основы теории принятия рискованных решений.

1. Поясните проблемы принятия решений, в которых речь идет о будущих полезных результатах.
2. Чем определяется неопределенность будущих результатов, а также риски при принятии решений в сфере бизнеса?
3. В чем состоят особенности влияния различных факторов риска на будущие результаты?
4. Поясните особенности влияния неустранимой неопределенности на будущие результаты.
5. Какие формы моделирования неопределенности будущих результатов вы можете отметить?
6. В чем заключаются особенности риска как результата моделирования неопределенности? В чем состоит субъективный характер подобных моделей?
7. Поясните основные формы оценки или измерения риска.
8. Какова специфика измерения риска в условиях конкретного бизнеса?
9. Почему рискованные оценки не позволяют однозначно прогнозировать будущий результат?
10. В чем заключается основная задача управления рисками бизнеса в реальном секторе экономики?
11. Поясните особенности оценки стоимости рискованного капитала на основе моделируемых распределений будущих результатов.
12. Перечислите основные разделы теории управления рисками.
13. Чем определяются риски при принятии решений в сфере реального бизнеса?
14. В чем состоят основные задачи управления рисками в сфере реальной экономики?
15. Каковы различия между единичным и корпоративными рисками проекта?
16. Поясните особенности внутренних и внешних факторов риска.
17. В чем состоят особенности влияния факторов риска, неизвестных на момент принятия решений?
18. Каково влияние инфляционного риска на результаты бизнеса?

19. Как влияют колебания обменного курса конвертируемой валюты на риск конкретных инвестиций?
20. Каковы роль и значение селективного риска?

## **Раздел 2. Методы учета риска при обосновании долгосрочных проектов материальных инвестиций.**

1. В чем заключается концепция устойчивости инвестиционного проекта?
2. Как связана устойчивость инвестиционного проекта с риском его реализации?
3. В чем состоит метод анализа чувствительности долгосрочного инвестиционного проекта?
4. Каковы особенности практического использования анализа чувствительности?
5. Каковы особенности использования частных производных и коэффициентов эластичности для анализа чувствительности?
6. В чем состоят достоинства и недостатки имитационных методов анализа чувствительности?
7. Какие недостатки или проблемы применения метода Монте-Карло вы можете отметить?
8. Какие характеристики распределения NPV проекта или других его показателей могут быть получены в результате применения метода Монте-Карло?
9. В чем состоят особенности количественной оценки риска реализации долгосрочных инвестиционных проектов? Какие меры риска для этого используются?
10. Какие возможности оценки субъективных вероятностей будущих событий вы знаете?
11. Поясните особенности основных мер риска проектов долгосрочных инвестиций.
12. Покажите роль и значение формируемого распределения чистой настоящей стоимости проекта при оценке риска проекта.
13. Поясните условия формирования дерева событий.
14. В чем состоят различия корневого узла, узла событий и конечных узлов дерева событий?
15. Определите особенности выделения сценариев будущего развития в условиях переходной экономики.
16. В чем заключаются проблемы и трудности обоснования сценариев будущего развития с учетом действий конкурентов?
17. Поясните особенности влияния этапа принятия решения на оценку риска и ожидаемого значения чистой настоящей стоимости инвестиционного проекта.

## **Раздел 3. Управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта.**

1. Поясните основные разновидности решений по оперативному управлению риском.
2. Объясните основные стратегии управления рисками в сфере реальной экономики.
3. В чем состоят особенности оперативного управления долгосрочным инвестиционным проектом?
4. Какая исходная информация нужна для управления рисками с помощью инвестиций в рекламу?
5. Покажите особенности диверсификации как метода управления риском.
6. В чем заключаются различия использования проектов, обеспечивающих выпуск взаимодополняемых и взаимозаменяемых товаров?
7. Каковы особенности анализа диверсификации капитала между проектами с независимыми доходами?
8. Что понимается под реальным опционом?
9. В чем состоят различия между реальными и рыночными опционами?
10. Какие виды реальных опционов вы знаете?
11. Объясните роль гибкости производства и технологии как важнейшей предпосылки использования реальных опционов для управления рисками.
12. Какие факторы определяют стоимость реальных опционов?
13. В чем заключаются особенности позиций каждой из сторон в условиях реального опциона?
14. Поясните суть комбинированного реального опциона.
15. В чем состоит отличие стратегий атакующего и защитного типа, реализацию которых обеспечивает применение реальных опционов?
16. Поясните формальные различия между реальными опционами на прекращение, приостановку и развитие проекта.
17. Сформулируйте принципиальные отличия встроенного или внутреннего реального опциона.
18. Поясните основные особенности использования смешанной стратегии управления рисками инвестиций с учетом реальных опционов.
19. Покажите роль и значение откладывания рискованного решения в форме встроенного реального опциона. Какие риски при этом сохраняются?
20. Поясните стратегии принятия инвестиционных решений с учетом реальных опционов.

**5.3 Определение соотношения объема занятий, проведенное путем непосредственного взаимодействия педагогического работника с обучающимися по заочной форме**

Виды контактной работы	Образовательные технологии		Контактная работа	
	Объем занятий, проводимых путем непосредственного взаимодействия педагогического работника с обучающимися (ак.ч)	Объем занятий с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий (ак.ч)	(всего ак.ч.)	в том числе в форме практической подготовки ( ак.ч.)
Лекционного типа (лекции)	2	-	2	-
Семинарского типа (семинар)	-	-	-	-
Семинарского типа (практические занятия)	-	6	6	-
в том числе в форме практической подготовки	-	-	-	2
Семинарского типа (курсовое проектирование (работа))	-	-	-	-
Семинарского типа (лабораторные работы)	-	-	-	-
в том числе в форме практической подготовки	-	-	-	-
Промежуточная аттестация (экзамен)	2,2	-	2,2	-
Итого	4,2	6	10,2	2

*Соотношение объема занятий, проведенных путем непосредственного взаимодействия педагогического работника с обучающимися по заочной форме – 41 %*

**6. Методические указания по освоению дисциплины**

**6.1 Учебно-методическое обеспечение дисциплины**

*Методические указания для преподавателя*

Изучение дисциплины проводится в форме лекций, практических занятий, организации самостоятельной работы студентов, консультаций. Главное назначение лекции - обеспечить теоретическую основу обучения, развить интерес к учебной деятельности и конкретной учебной дисциплине, сформировать у студентов ориентиры для самостоятельной работы над курсом.

Основной целью практических занятий является обсуждение наиболее сложных теоретических вопросов курса, их методологическая и методическая проработка. Они проводятся в форме опроса, диспута, тестирования, обсуждения докладов и пр.

Самостоятельная работа с научной и учебной литературой, дополняется работой с тестирующими системами, тренинговыми программами, с информационными базами, образовательным ресурсом электронной информационно-образовательной среды и сети Интернет.

**6.2 Методические материалы обучающимся по дисциплине, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности**

Методические материалы доступны на сайте «Личная студия» в разделе «Методические указания и пособия».

1. Методические указания «Введение в технологию обучения».
  2. Методические указания по проведению учебного занятия «Вебинар».
  3. Методические указания по проведению занятия «Семинар-обсуждение устного эссе», «Семинар-обсуждение устного доклада».
  4. Методические указания по проведению занятия «Семинар – семинар-ассесмент реферата».
  5. Методические указания по проведению занятия «Семинар – обсуждение реферата».
  6. Методические указания по проведению учебного занятия с компьютерным средством обучения «Практическое занятие - тест-тренинг».
  7. Методические указания по проведению учебного занятия с компьютерным средством обучения «Практическое занятие - глоссарный тренинг».
  8. Методические указания по проведению занятия «Практическое занятие - позетовое тестирование».
  9. Положение о реализации электронного обучения, дистанционных образовательных технологий.
  10. Методические указания по проведению занятия «Практическое занятие - алгоритмический тренинг».
- Указанные методические материалы для обучающихся доступны в Личной студии обучающегося, в разделе ресурсы.

### **6.3 Особенности реализации дисциплины в отношении лиц из числа инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья**

Студенты с ограниченными возможностями здоровья, в отличие от остальных студентов, имеют свои специфические особенности восприятия и переработки учебного материала.

Подбор и разработка учебных материалов должны производиться с учетом того, чтобы предоставлять этот материал в различных формах так, чтобы инвалиды с нарушениями слуха получали информацию визуально, с нарушениями зрения - аудиально (например, с использованием программ-синтезаторов речи) или с помощью тифлоинформационных устройств.

Выбор средств и методов обучения осуществляется самим преподавателем. При этом в образовательном процессе рекомендуется использование социально-активных и рефлексивных методов обучения, технологий социокультурной реабилитации с целью оказания помощи в установлении полноценных межличностных отношений студентов с ограниченными возможностями здоровья с преподавателями и другими студентами, создания комфортного психологического климата в студенческой группе.

Разработка учебных материалов и организация учебного процесса проводится с учетом нормативных документов и локальных актов образовательной организации.

В соответствии с нормативными документами инвалиды и лица с ограниченными возможностями здоровья по зрению имеют право присутствовать на занятиях вместе с ассистентом, оказывающим обучающемуся необходимую помощь; инвалиды и лица с ограниченными возможностями здоровья по слуху имеют право на использование звукоусиливающей аппаратуры.

При проведении промежуточной аттестации по дисциплине обеспечивается соблюдение следующих общих требований:

- проведение аттестации для инвалидов в одной аудитории совместно с обучающимися, не являющимися инвалидами, если это не создает трудностей для инвалидов и иных обучающихся при прохождении государственной итоговой аттестации;
- присутствие в аудитории ассистента (ассистентов), оказывающего обучающимся инвалидам необходимую техническую помощь с учетом их индивидуальных особенностей (занять рабочее место, передвигаться, прочитать и оформить задание, общаться с экзаменатором);
- пользование необходимыми обучающимся инвалидам техническими средствами при прохождении аттестации с учетом их индивидуальных особенностей;
- обеспечение возможности беспрепятственного доступа обучающихся инвалидов в аудитории, туалетные и другие помещения, а также их пребывания в указанных помещениях.

По письменному заявлению обучающегося инвалида продолжительность сдачи обучающимся инвалидом экзамена может быть увеличена по отношению к установленной продолжительности его сдачи:

- продолжительность сдачи экзамена, проводимого в письменной форме, - не более чем на 90 минут;
- продолжительность подготовки обучающегося к ответу на экзамене, проводимом в устной форме, - не более чем на 20 минут.

В зависимости от индивидуальных особенностей обучающихся с ограниченными возможностями здоровья организация обеспечивает выполнение следующих требований при проведении аттестации:

- а) для слепых:
  - задания и иные материалы для сдачи экзамена оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением для слепых, либо зачитываются ассистентом;
  - письменные задания выполняются обучающимися с использованием клавиатуры с азбукой Брайля, либо надиктовываются ассистенту;
- б) для слабовидящих:

- задания и иные материалы для сдачи экзамена оформляются увеличенным шрифтом и/или использованием специализированным программным обеспечением Jaws;
- обеспечивается индивидуальное равномерное освещение не менее 300 люкс;
- при необходимости обучающимся предоставляется увеличивающее устройство, допускается использование увеличивающих устройств, имеющихся у обучающихся;
- в) для глухих и слабослышащих, с тяжелыми нарушениями речи:
  - имеется в наличии информационная система "Исток" для слабослышащих коллективного пользования;
  - по их желанию испытания проводятся в электронной или письменной форме;
- г) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
  - тестовые и тренинговые задания по текущей и промежуточной аттестации выполняются обучающимися на компьютере через сайт «Личная студия» с использованием электронного обучения, дистанционных технологий;
  - для обучения лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата используется электронный образовательный ресурс, электронная информационно-образовательная среда;
  - по их желанию испытания проводятся в устной форме.

О необходимости обеспечения специальных условий для проведения аттестации обучающийся должен сообщить письменно не позднее, чем за 10 дней до начала аттестации. К заявлению прилагаются документы, подтверждающие наличие у обучающегося индивидуальных особенностей (при отсутствии указанных документов в организации).

#### **6.4 Методические рекомендации по самостоятельной работе студентов**

Цель самостоятельной работы - подготовка современного компетентного специалиста и формирование способностей и навыков к непрерывному самообразованию и профессиональному совершенствованию.

Реализация поставленной цели предполагает решение следующих задач:

- качественное освоение теоретического материала по изучаемой дисциплине, углубление и расширение теоретических знаний с целью их применения на уровне межпредметных связей;
- систематизация и закрепление полученных теоретических знаний и практических навыков;
- формирование умений по поиску и использованию нормативной, правовой, справочной и специальной литературы, а также других источников информации;
- развитие познавательных способностей и активности, творческой инициативы, самостоятельности, ответственности и организованности;
- формирование самостоятельности мышления, способностей к саморазвитию, самообразованию, самосовершенствованию и самореализации;
- развитие научно-исследовательских навыков;
- формирование умения решать практические задачи (в профессиональной деятельности), используя приобретенные знания, способности и навыки.

Самостоятельная работа является неотъемлемой частью образовательного процесса.

Самостоятельная работа предполагает инициативу самого обучающегося в процессе сбора и усвоения информации, приобретения новых знаний, умений и навыков и ответственность его за планирование, реализацию и оценку результатов учебной деятельности. Процесс освоения знаний при самостоятельной работе не обособлен от других форм обучения.

Самостоятельная работа должна:

- быть выполнена индивидуально (или являться частью коллективной работы). В случае, когда СР подготовлена в порядке выполнения группового задания, в работе делается соответствующая оговорка;
- представлять собой законченную разработку (этап разработки), в которой анализируются актуальные проблемы по определенной теме и ее отдельных аспектов;
- отражать необходимую и достаточную компетентность автора;
- иметь учебную, научную и/или практическую направленность;
- быть оформлена структурно и в логической последовательности: титульный лист, оглавление, основная часть, заключение, выводы, список литературы, приложения,
- содержать краткие и четкие формулировки, убедительную аргументацию, доказательность и обоснованность выводов;
- соответствовать этическим нормам (правила цитирования и парафраз; ссылки на использованные библиографические источники; исключение плагиата, дублирования собственного текста и использования чужих работ).

##### **6.4.1 Формы самостоятельной работы обучающихся по разделам дисциплины**

###### **Раздел 1. Основы теории принятия рискованных решений.**

###### **Темы реферата:**

1. Напишите реферат-рецензию на статью: Николаенко Валентин Сергеевич Риск, риск-менеджмент и неопределенность: уточнение понятий // Государственное управление. Электронный вестник. 2020. №81. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/risk-risk-menedzhment-i-neopredelennost-utochnenie-ponyatiy>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
2. Напишите реферат-рецензию на статью: Четыркина Наталья Юрьевна, Васильева Яна Александровна ГЕНЕЗИС И СООТНОШЕНИЕ ПОНЯТИЙ РИСКА И НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ // Петербургский экономический журнал. 2020. №2. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/genezis-i-sootnoshenie-ponyatiy-riska-i-neopredelennosti>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
3. Напишите реферат-рецензию на статью: Пупенцова С.В., Титов А.Б., Ливинцова М.Г. ОЦЕНКА ИНВЕСТИЦИОННОЙ ПРИВЛЕКАТЕЛЬНОСТИ ПРЕДПРИЯТИЯ В УСЛОВИЯХ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ И РИСКА // Вестник ВУиТ. 2020. №1 (45). URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/otsenka-investitsionnoy-privlekatelnosti-predpriyatiya-v-usloviyah-neopredelennosti-i-riska>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
4. Напишите реферат-рецензию на статью: А. Г. Байербах НЕКОТОРЫЕ ПОДХОДЫ К ОПРЕДЕЛЕНИЮ СУЩНОСТИ И КЛАССИФИКАЦИИ ЭКОНОМИЧЕСКИХ РИСКОВ // Экономика и бизнес: теория и практика. 2020. №2-1. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/nekotorye-podhody-k-opredeleniyu-suschnosti-i-klifikatsii-ekonomicheskikh-riskov>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
5. Напишите реферат-рецензию на статью: Шаститко Андрей Евгеньевич, Курдин Александр Александрович В ОЖИДАНИИ НЕПРЕДВИДЕННОГО // ВТЭ. 2020. №2. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/v-ozhidanii-nepredvidennogo>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
6. Напишите реферат-рецензию на статью: Пашаев М.М. СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ. МЕТОДИКА ОЦЕНКИ БИЗНЕС-РИСКА ПО КРЕДИТНОМУ РЕЙТИНГУ // Экономика и бизнес: теория и практика. 2020. №5-3. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/sistema-upravleniya-riskami-metodika-otsenki-biznes-riska-po-kreditnomu-reytingu>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
7. Напишите реферат-рецензию на статью: Минеев Денис Геннадьевич, Попова Ирина Владимировна ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКИЕ РИСКИ // StudNet. 2020. №10. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/predprinimatelskie-riski-1>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
8. Напишите реферат-рецензию на статью: Антюшина А.В. МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ КОМПАНИИ В СОВРЕМЕННЫХ УСЛОВИЯХ // Экономика и бизнес: теория и практика. 2020. №4-1. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/metody-upravleniya-riskami-kompanii-v-sovremennyh-usloviyah>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
9. Напишите реферат-рецензию на статью: Конюкова О.Л., Платти А.М. СТРАХОВАНИЕ КАК МЕТОД УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ ХОЛДИНГА ОАО «РЖД» // Экономика и бизнес: теория и практика. 2020. №5-1. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/strahovanie-kak-metod-upravleniya-riskami-holdinga-oao-rzhd>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
10. Напишите реферат-рецензию на статью: Панкратова Лариса Дмитриевна СИСТЕМА УПРАВЛЕНИЯ ПРОЕКТНЫМИ РИСКАМИ // Московский экономический журнал. 2020. №4. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/sistema-upravleniya-proektnymi-riskami>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
11. Напишите реферат-рецензию на статью: Савельева Л.А., Вдовин С.А. ЭКОНОМИКО-МАТЕМАТИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ ДЛЯ ЭТАПОВ АЛГОРИТМА УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ ОБЪЕКТОВ ЭКОНОМИКИ // Инновации и инвестиции. 2020. №4. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/ekonomiko-matematicheskie-metody-dlya-etapov-algoritma-upravleniya-riskami-obektov-ekonomiki>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
12. Напишите реферат-рецензию на статью: Котлярова О.А., Тикишан А.В. ПОВЫШЕНИЕ ЭФФЕКТИВНОСТИ УПРАВЛЕНИЯ КОМПАНИЕЙ: ФАКТОР СНИЖЕНИЯ РИСКА БАНКРОТСТВА // Экономика и бизнес: теория и практика. 2020. №4-2. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/povyshenie-effektivnosti-upravleniya-kompaniey-faktor-snizheniya-riska-bankrotstva>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
13. Напишите реферат-рецензию на статью: Наточеева Наталья Николаевна, Гуриева Лира Константиновна, Кузнецова Виктория Игоревна ОЦЕНКА ФИНАНСОВЫХ РИСКОВ В ОРГАНИЗАЦИИ // Научен вектор на Балканите. 2020. №1 (7). URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/otsenka-finansovyh-riskov-v-organizatsii>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
14. Напишите реферат-рецензию на статью: Винокур И.Р. МЕТОДИКА АНАЛИЗА И УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ. КОЛИЧЕСТВЕННАЯ ОЦЕНКА РИСКОВ // Вестник ПНИПУ. Социально-экономические науки. 2020. №1. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/metodika-analiza-i-upravleniya-riskami-kolichestvennaya-otsenka>.

riskov. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

15. Напишите реферат-рецензию на статью: Орлов А.А. МЕХАНИЗМЫ НЕЙТРАЛИЗАЦИИ ФИНАНСОВЫХ РИСКОВ ПРЕДПРИЯТИЯ // Инновации и инвестиции. 2020. №2. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/mehanizmy-neytralizatsii-finansovyh-riskov-predpriyatiya-1>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

16. Напишите реферат-рецензию на статью: Р. С. Солдатов СОВЕРШЕНСТВОВАНИЕ СИСТЕМЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ В РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ // Международный журнал гуманитарных и естественных наук. 2020. №2-2. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/sovershenstvovanie-sistemy-upravleniya-riskami-v-rossiyskoy-federatsii>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

17. Напишите реферат-рецензию на статью: Мусавузова М.М. ОЦЕНКА РИСКОВ, ВЛИЯЮЩИХ НА ЭФФЕКТИВНОСТЬ ИНВЕСТИЦИОННЫХ ПРОЕКТОВ // Инновации и инвестиции. 2020. №2. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/otsenka-riskov-vliyayuschih-na-effektivnost-investitsionnyh-proektov>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

18. Напишите реферат-рецензию на статью: А. А. Адаменко, Д. В. Петров, В. В. Маркелов КЛАССИФИКАЦИЯ ФАКТОРОВ РИСКА ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ // ЕГИ. 2020. №2 (28). URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/klassifikatsiya-faktorov-riska-predprinimatelskoy-deyatelnosti>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

19. Напишите реферат-рецензию на статью: Лесная И.А. РИСКИ КОММЕРЧЕСКОЙ ОРГАНИЗАЦИИ - ПУТИ И СПОСОБЫ ИХ СНИЖЕНИЯ // Экономика и бизнес: теория и практика. 2020. №4-1. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/riski-kommercheskoy-organizatsii-puti-i-sposoby-ih-snizheniya>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

20. Напишите реферат-рецензию на статью: Алиева Кызы С. Т. УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМИ РИСКАМИ // ЭВД. 2020. №1 (59). URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/upravlenie-investitsionnymi-riskami-5>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

## **Раздел 2. Методы учета риска при обосновании долгосрочных проектов материальных инвестиций.**

### **Темы реферата:**

1. Напишите реферат-рецензию на статью: Акулова Анастасия Игоревна, Фокина Ольга Михайловна АНАЛИЗ ЧУВСТВИТЕЛЬНОСТИ И ЕГО РОЛЬ В ПРИНЯТИИ РЕШЕНИЙ ПО ИНВЕСТИЦИОННОМУ ПРОЕКТУ // Инновационная экономика: перспективы развития и совершенствования. 2020. №3 (45). URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/analiz-chuvstvitelnosti-i-ego-rol-v-prinyatii-resheniy-po-investitsionnomu-proektu>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

2. Напишите реферат-рецензию на статью: Соколовская Е.Н. РОЛЬ СТАВКИ ДИСКОНТИРОВАНИЯ В ОЦЕНКЕ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПРОЕКТА // Инновации и инвестиции. 2020. №3. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/rol-stavki-diskontirovaniya-v-otsenke-investitsionnogo-proekta>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

3. Напишите реферат-рецензию на статью: Тамер О.С. АДДИТИВНЫЕ И МУЛЬТИПЛИКАТИВНЫЕ МОДЕЛИ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ В ИНВЕСТИЦИОННОМ ПРОЕКТИРОВАНИИ // Вестник ВУиТ. 2020. №1 (45). URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/additivnye-i-multiplikativnye-modeli-vremennyh-ryadov-v-investitsionnom-proektirovanii>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

4. Напишите реферат-рецензию на статью: Колодко Дмитрий Владимирович ИЕРАРХИЧЕСКИЙ МЕТОД РАНДОМИЗИРОВАННЫХ СВОДНЫХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ И ЕГО ПРИМЕНЕНИЕ ДЛЯ СРАВНЕНИЯ ИНВЕСТИЦИОННОЙ ПРИВЛЕКАТЕЛЬНОСТИ ПРОЕКТОВ // Теоретическая и прикладная экономика. 2020. №1. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/ierarhicheskiy-metod-randomizirovannyh-svodnyh-pokazateley-i-ego-primeneniye-dlya-sravneniya-investitsionnoy-privlekatelnosti>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

5. Напишите реферат-рецензию на статью: Данько Евгений Викторович, Ергалиев Ерлан Канапиянович, Мадияров Мураткан Набенович ВЫЧИСЛИТЕЛЬНЫЕ МЕТОДЫ В ЗАДАЧАХ СУБЪЕКТИВНОЙ ОЦЕНКИ ЭФФЕКТИВНОСТИ ИНВЕСТИЦИОННЫХ РЕШЕНИЙ // Известия АлтГУ. 2020. №1 (111). URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/vychislitelnye-metody-v-zadachah-subektivnoy-otsenki-effektivnosti-investitsionnyh-resheniy>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

6. Напишите реферат-рецензию на статью: Беляев И. Д., Беляева М. Б. ОЦЕНКА РИСКОВ ПРИ ИНВЕСТИРОВАНИИ В ЦЕННЫЕ БУМАГИ // Colloquium-journal. 2020. №5 (57). URL:

- <https://cyberleninka.ru/article/n/otsenka-riskov-pri-investirovanii-v-tsennye-bumagi>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
7. Напишите реферат-рецензию на статью: Беширов Мурад Джамалович ДИВЕРСИФИКАЦИЯ КАК ИНСТРУМЕНТ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ // Московский экономический журнал. 2020. №4. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/diversifikatsiya-kak-instrument-upravleniya-riskami-investitsionnogo-portfelya>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
8. Напишите реферат-рецензию на статью: Филина А.Д. АКТУАЛЬНЫЕ СПОСОБЫ ПОВЫШЕНИЯ ЭФФЕКТИВНОСТИ РЕТРОСПЕКТИВНОГО АНАЛИЗА РИСКОВ ПРОЕКТА НА ЭТАПЕ ПРЕДЫНВЕСТИЦИОННЫХ ИССЛЕДОВАНИЙ // Инновации и инвестиции. 2020. №4. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/aktualnye-sposoby-povysheniya-effektivnosti-retrospektivnogo-analiza-riskov-proekta-na-etape-predynvestitsionnyh-issledovaniy>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
9. Напишите реферат-рецензию на статью: Мишин Андрей Александрович ВОПРОСЫ ИНВЕСТИРОВАНИЯ В ВЫСОКОДОХОДНЫЕ ОБЛИГАЦИИ // Научные труды Вольного экономического общества России. 2020. №1. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/voprosy-investirovaniya-v-vysokodohodnye-obligatsii>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
10. Напишите реферат-рецензию на статью: Романова Елена Викторовна РЕАЛЬНЫЕ ОПЦИОНЫ КАК ИНСТРУМЕНТ АНАЛИЗА ИННОВАЦИОННЫХ ПРОЕКТОВ // Вестник науки и образования. 2020. №12-2 (90). URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/realnye-optiony-kak-instrument-analiza-innovatsionnyh-proektov>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
11. Напишите реферат-рецензию на статью: Ипатьев Иван Романович УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ И ОСНОВНЫЕ ПРОБЛЕМЫ ИСПОЛЬЗОВАНИЯ ВНЕБИРЖЕВЫХ ПРОИЗВОДНЫХ ФИНАНСОВЫХ ИНСТРУМЕНТОВ. СТРАХОВАНИЕ ОПЦИОННЫХ ПОЗИЦИЙ // Финансовые рынки и банки. 2020. №3. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/upravlenie-riskami-i-osnovnye-problemy-ispolzovaniya-vnebirzhevyyh-proizvodnyh-finansovyh-instrumentov-strahovanie-optsiornyh>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
12. Напишите реферат-рецензию на статью: Рыбкина Виктория Дмитриевна ФОРМИРОВАНИЕ ПОРТФЕЛЯ ЦЕННЫХ БУМАГ, ОСНОВНЫЕ ПРИНЦИПЫ // StudNet. 2020. №6. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/formirovanie-portfelya-tsennyh-bumag-osnovnye-printsipy>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
13. Напишите реферат-рецензию на статью: Винокур И.Р. МЕТОДИКА АНАЛИЗА И УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ. КОЛИЧЕСТВЕННАЯ ОЦЕНКА РИСКОВ // Вестник ПНИПУ. Социально-экономические науки. 2020. №1. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/metodika-analiza-i-upravleniya-riskami-kolichestvennaya-otsenka-riskov>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
14. Напишите реферат-рецензию на статью: Якушин Дмитрий Иванович, Юдин Сергей Владимирович МЕТОДЫ СТРАХОВАНИЯ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ // Концепт. 2020. №7. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/metody-strahovaniya-investitsionnogo-portfelya>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
15. Напишите реферат-рецензию на статью: Минасян Виген Бабкенович НОВЫЕ СПОСОБЫ ИЗМЕРЕНИЯ КАТАСТРОФИЧЕСКИХ ФИНАНСОВЫХ РИСКОВ: МЕРЫ «VAR В СТЕПЕНИ Т» И ИХ ВЫЧИСЛЕНИЕ // Финансы: теория и практика. 2020. №3. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/novye-sposoby-izmereniya-katastroficheskikh-finansovyh-riskov-mery-var-v-stepeni-t-i-ih-vychislenie>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
16. Напишите реферат-рецензию на статью: Ковлякова В.Е. ИНТЕГРАЦИЯ СИСТЕМЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ И ВОЗМОЖНОСТЯМИ В СИСТЕМУ МЕНЕДЖМЕНТА // Компетентность. 2020. №3. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/integratsiya-sistemy-upravleniya-riskami-i-vozmozhnostyami-v-sistemu-menedzhmenta-1>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
17. Напишите реферат-рецензию на статью: Т. В. Александрова, А. В. Дубинин Картографирование как инструмент измерения проектного риска // Экономика и бизнес: теория и практика. 2019. №4-1. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/kartografirovanie-kak-instrument-izmereniya-proektnogo-riska>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
18. Напишите реферат-рецензию на статью: Сидоров Александр Андреевич Измерение риска рыночной ликвидности портфеля рыночных ценных бумаг // Вестник евразийской науки. 2019. №2. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/izmerenie-riska-rynochnoy-likvidnosti-portfelya-rynochnyyh-tsennyh-bumag>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.
19. Напишите реферат-рецензию на статью: Бочков С. П. СПОСОБ ИЗМЕРЕНИЯ РИСКА ИНВЕСТИЦИОННОГО ПРОЕКТА ПО РЕАЛЬНЫМ АКТИВАМ НА ПРЕДИНВЕСТИЦИОННОМ ЭТАПЕ //

Россия: тенденции и перспективы развития. 2019. №14-2. URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/sposob-izmereniya-riska-investitsionnogo-proekta-po-realnym-aktivam-na-predinvestitsionnom-etape>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

20. Напишите реферат-рецензию на статью: Коцюба Алексей Станиславович РАЗВИТИЕ ИНСТРУМЕНТАРИЯ ИЗМЕРЕНИЯ РИСКА ПРИ МОДЕЛИРОВАНИИ НЕОПРЕДЕЛЕННОСТИ С ПОМОЩЬЮ НЕЧЕТКО-МНОЖЕСТВЕННОГО ПОДХОДА // БИ. 2019. №11 (502). URL: <https://cyberleninka.ru/article/n/razvitie-instrumentariya-izmereniya-riska-pri-modelirovanii-neopredelennosti-s-pomoschyu-nechetko-mnozhestvennogo-podhoda>. Сформулируйте основные утверждения автора. Выразите свое мнение по поводу утверждений автора и обоснуйте его.

## 7. Фонд оценочных материалов для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине

### 7.1. Система оценивания результатов текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации, а также критерии выставления оценок, описание шкал оценивания

№ п/п	Наименование формы проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации	Описание показателей оценочного материала	Представление оценочного материала в фонде	Критерии и описание шкал оценивания (шкалы: 0 – 100%, четырехбалльная, тахометрическая)
1	<i>Тест-тренинг</i>	Вид тренингового учебного занятия, задачей которого является закрепление учебного материала, а также проверка знаний обучающегося как по дисциплине в целом, так и по отдельным темам (разделам) дисциплины .	Система стандартизированных заданий	- от 0 до 69,9 % выполненных заданий – не зачтено; - 70 до 100 % выполненных заданий – зачтено.
2	<i>Экзамен</i>	1-я часть экзамена: выполнение обучающимися практико-ориентированных заданий (аттестационное испытание промежуточной аттестации, проводимое устно с использованием телекоммуникационных технологий)	Практико-ориентированные задания	<i>Критерии оценивания преподавателем практико-ориентированной части экзамена:</i> – соответствие содержания ответа заданию, полнота раскрытия темы/задания (оценка соответствия содержания ответа теме/заданию); – умение проводить аналитический анализ прочитанной учебной и научной литературы, сопоставлять теорию и практику; – логичность, последовательность изложения ответа; – наличие собственного отношения обучающегося к теме/заданию; – аргументированность, доказательность излагаемого материала. <i>Описание шкалы оценивания практико-ориентированной части экзамена</i> Оценка «отлично» выставляется за ответ, в котором содержание соответствует теме или

№ п/п	Наименование формы проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации	Описание показателей оценочного материала	Представление оценочного материала в фонде	Критерии и описание шкал оценивания (шкалы: 0 – 100%, четырёхбалльная, тахометрическая)
				<p>заданию, обучающийся глубоко и прочно усвоил учебный материал, последовательно, четко и логически стройно излагает его, демонстрирует собственные суждения и размышления на заданную тему, делает соответствующие выводы; умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, приводит материалы различных научных источников, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения задания, показывает должный уровень сформированности компетенций.</p> <p>Оценка «<i>хорошо</i>» выставляется обучающемуся, если ответ соответствует и раскрывает тему или задание, показывает знание учебного материала, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей при выполнении задания, правильно применяет теоретические положения при выполнении задания, владеет необходимыми навыками и приемами его выполнения, однако испытывает небольшие затруднения при формулировке собственного мнения, показывает должный уровень сформированности компетенций.</p> <p>Оценка «<i>удовлетворительно</i>» выставляется обучающемуся, если ответ в полной мере раскрывает тему/задание, обучающийся имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения</p>

№ п/п	Наименование формы проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации	Описание показателей оценочного материала	Представление оценочного материала в фонде	Критерии и описание шкал оценивания (шкалы: 0 – 100%, четырехбалльная, тахометрическая)
				<p>логической последовательности в изложении учебного материала по заданию, его собственные суждения и размышления на заданную тему носят поверхностный характер.</p> <p>Оценка «неудовлетворительно» выставляется обучающемуся, если не раскрыта тема, содержание ответа не соответствует теме, обучающийся не обладает знаниями по значительной части учебного материала и не может грамотно изложить ответ на поставленное задание, не высказывает своего мнения по теме, допускает существенные ошибки, ответ выстроен непоследовательно, неаргументированно.</p> <p>Итоговая оценка за экзамен выставляется преподавателем в совокупности на основе оценивания результатов электронного тестирования обучающихся и выполнения ими практико-ориентированной части экзамена</p>
		2-я часть экзамена: выполнение электронного тестирования (аттестационное испытание промежуточной аттестации с использованием информационных тестовых систем)	Система стандартизированных заданий (тестов)	<p><i>Описание шкалы оценивания электронного тестирования:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>– от 0 до 49,9 % выполненных заданий – неудовлетворительно;</li> <li>– от 50 до 69,9% – удовлетворительно;</li> <li>– от 70 до 89,9% – хорошо;</li> <li>– от 90 до 100% – отлично</li> </ul>

**7.2 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**

**Раздел 1**

**Задание**

Порядковый номер задания	1.
Тип	2
Вес	1

Почему инвестиции в исследования и разработки обладают высоким уровнем риска? доступ к интеллектуальным ресурсам затруднен
---

	патент на изобретение могут не выдать
	обычно они не приносят доходов
	обычно они не окупаются
	требуются сравнительно высокие первоначальные вложения

**Задание**

Порядковый номер задания	2.
Тип	2
Вес	2

Отметьте практические способы обоснования рискованных решений компанией:	
	нахождение критериев оценки рискованных решений
	применение методов управления рисками
	воспроизведение всех решений фирмы – лидера на рынке в собственной практике
	моделирование распределений будущих результатов

**Задание**

Порядковый номер задания	3.
Тип	2
Вес	2

Уровень предпринимательского риска в реальном секторе экономики определяется:	
	методом измерения риска
	сферой деятельности
	ожиданиями и представлениями предпринимателя
	объективно существующей неопределенностью будущих результатов

**Задание**

Порядковый номер задания	4.
Тип	2
Вес	2

Модели измерения рисков, которые учитывают вероятности, установленные субъективно, - это	
	АРТ
	дискретная вероятностная модель
	экспертное построение распределения
	САРМ

**Задание**

Порядковый номер задания	5.
Тип	1
Вес	1

НЕ исследовал природу риска - это	
	Ф. Найт
	Р. Ругнер
	Р. Денк
	Ф. Бэкон

**Задание**

Порядковый номер задания	6.
Тип	2
Вес	2

Основные причины неопределенности результатов деятельности организации:	
	случайность в реализации факторов
	появление неизвестных факторов
	отсутствие планового ценообразования
	асимметрия информации
	противодействие конкурентов

**Задание**

Порядковый номер задания	7.
Тип	1
Вес	1

Для какого сектора экономики риск бизнеса в широком смысле означает неоднозначную определенность получения будущих доходов под влиянием всей совокупности определяющих их внутренних и внешних факторов?	
	высокотехнологичного
	реального
	фармацевтического
	финансового

**Задание**

Порядковый номер задания	8.
Тип	4
Вес	1

В случае, когда менеджер анализирует риск портфеля материальных инвестиционных проектов фирмы и его интересуется, каков будет риск исследуемого инвестиционного проекта, если данный проект будет включен в состав этого портфеля, ему следует выявить _____ риск инвестиционного проекта.	
	корпоративный

**Задание**

Порядковый номер задания	9.
Тип	2
Вес	2

Какие особенности учета риска бизнеса подходят для предприятий реального сектора экономики?	
	отсутствие данных о прошлом развитии аналогичных производств
	ускоренная реакция бизнеса на изменения во внешней среде
	специфическая экономическая интерпретация
	распределение будущих полезных результатов

**Задание**

Порядковый номер задания	10.
Тип	2
Вес	2

К каким последствиям приводит рост инфляции?	
	рост расходов на заработную плату
	отток капитала из страны
	увеличение процентных ставок по кредитам
	замедление развития предприятий – экспортеров

**Задание**

Порядковый номер задания	11.
Тип	2
Вес	2

Внешние факторы риска:	
	валютный риск
	риск простоя оборудования
	риск изменения цен
	кредитный риск

**Задание**

Порядковый номер задания	12.
Тип	2
Вес	2

НЕ является внешними факторами риска:	
	инфляция
	финансовая устойчивость
	обменный курс
	ликвидность
	ставка процента

**Задание**

Порядковый номер задания	13.
Тип	2

Вес	2
-----	---

Производственные факторы риска определяются:	
	взаимоотношениями в коллективе
	особенностями отрасли бизнеса
	организацией менеджмента организации
	политикой процентных ставок
	стадией жизненного цикла организации

**Задание**

Порядковый номер задания	14.
Тип	2
Вес	2

НЕ является внутренними факторами риска - это	
	природно-климатические факторы
	риск ответственности
	техничко-технологические факторы
	вероятность потери имущества

**Задание**

Порядковый номер задания	15.
Тип	6
Вес	2

Выберите верное утверждение: А) Производственные факторы риска определяются взаимоотношениями в коллективе В) Производственные факторы риска определяются особенностями отрасли бизнеса	
	А - нет; В - да
	А - нет; В - нет
	А - да; В - да
	А - да; В - нет

**Раздел 2**

**Задание**

Порядковый номер задания	1.
Тип	4
Вес	1

Относительное увеличение зарплатоемкости продукции предполагает _____ конъюнктура рынка. неблагоприятная
---

**Задание**

Порядковый номер задания	2.
Тип	2
Вес	2

Основные разновидности решений по управлению инвестиционным риском:	
	получение сравнительно более надежной информации о перспективах осуществления инвестиционного проекта
	прекращение реализации проекта
	изменение параметров денежного потока инвестиционного проекта
	изменение метода расчета ставки дисконтирования

**Задание**

Порядковый номер задания	3.
Тип	4
Вес	1

Если чистая приведенная стоимость инвестиционного проекта приобретает отрицательное значение, то проект следует отклонить
--

**Задание**

Порядковый номер задания	4.
Тип	4
Вес	1

В управлении рисками бизнеса решение не может быть принято без участия \_\_\_\_\_ капитала.  
собственника

**Задание**

Порядковый номер задания	5.
Тип	4
Вес	1

В случае принятия решения о досрочном прекращении инвестиционного проекта организация реализует \_\_\_\_\_ стратегию управления рисками.  
защитную

**Задание**

Порядковый номер задания	6.
Тип	1
Вес	3

Первоначальные вложения в инвестиционный проект составляют 1 млн руб. Каждый месяц инвестиционный проект приносит доход в размере 53 648 рублей. Предположим, что ставка инфляции составляет 8 % годовых. Для повышения эффективности проекта компания решила вложить в первый месяц 500 тыс. руб. в рекламу, а во второй – 300 тыс. руб. На третий месяц инвестиционный проект должен приносить на 15,21 % больше. Через сколько месяцев инвестиции в проект окупятся?

	24
	20
	18
	22

**Задание**

Порядковый номер задания	7.
Тип	1
Вес	1

Методом снижения кредитного риска является:  
уклонение от налогов  
регулярная оценка платежеспособности предприятия  
получение кредита в различных валютах

**Задание**

Порядковый номер задания	8.
Тип	2
Вес	1

К приемам снижения риска относятся:

	избежание риска
	диверсификация
	самострахование
	лимитирование

**Задание**

Порядковый номер задания	9.
Тип	1
Вес	1

Метод отказа от риска заключается в  
ликвидации причин крупных убытков  
ликвидации службы управления рисками  
дополнительном финансировании управления рисками  
ликвидации последствий серьезных рисков

**Задание**

Порядковый номер задания	10.
--------------------------	-----

Тип	1
Вес	1

Метод, который представляет передачу риска, - это покрытие убытка	
	из резервов
	за счет использования займов
	за счет муниципальной поддержки
	на основе самострахования

**Задание**

Порядковый номер задания	11.
Тип	2
Вес	1

В основе страхования риска лежит	
	создание внутренних страховых фондов
	передача ответственности за риски внешним страховым компаниям
	передача ответственности за риски внутреннему менеджменту
	создание внешних страховых резервов

**Задание**

Порядковый номер задания	12.
Тип	2
Вес	1

Высокая результативность системы управления риском предполагает	
	отсутствие риска в деятельности организации
	снижение возможности возникновения рисков
	снижение возможностей возникновения негативных последствий риска
	повышение нормы прибыли организации

**Задание**

Порядковый номер задания	13.
Тип	2
Вес	1

Главные цели системы управления рисками в организации – это:	
	стабильность положения на рынке
	обеспечение прибыльности производства
	сохранение кадрового потенциала
	успешное функционирование в условиях неопределенности

**Задание**

Порядковый номер задания	14.
Тип	1
Вес	1

Почему классификация методов управления рисками является относительно условной?	
	нет достаточного методологического аппарата
	в реальной жизни сферы применения переплетаются
	не всегда менеджеры могут определить сферы применения
	все методы работают одинаково во всех сферах

**Задание**

Порядковый номер задания	15.
Тип	1
Вес	1

Процедура управления, которая способствует уменьшению неблагоприятных последствий риска для организации, - это	
	уклонение от риска
	сокращение риска
	передача риска
	все перечисленное

### Раздел 3

#### Задание

Порядковый номер задания	1.
Тип	2
Вес	2

Обычно сравнивают доходность лизинга для определения его эффективности с	
	банковской кредитной ставкой
	доходностью ведения бизнеса без учета предмета лизинга
	учетной ставкой ЦБ
	банковской депозитной ставкой

#### Задание

Порядковый номер задания	2.
Тип	3
Вес	2

Сопоставьте виды лизинга с их особенностями:	
финансовый	предмет лизингового договора передается лизингополучателю в собственность по окончании срока договора лизинга
оперативный	срок лизингового договора составляет меньшую часть нормативного срока службы предмета лизингового договора
действительный	лизингополучатель имеет опцион на покупку предмета лизинга по определенной цене в течение срока договора лизинга

#### Задание

Порядковый номер задания	3.
Тип	2
Вес	2

Какие изменения в денежных потоках инвестиционного проекта изменят значение дисперсии?	
	аналогичное сокращение всех компонент денежного потока
	сокращение ставки дисконтирования
	снижение первоначальной суммы инвестирования
	пропорциональное сокращение всех компонент денежного потока

#### Задание

Порядковый номер задания	4.
Тип	4
Вес	1

В течение срока договора и финансового, и оперативного лизинга лизингодатель остается _____ в отношении к предмету лизинга.
собственником

#### Задание

Порядковый номер задания	5.
Тип	1
Вес	1

У инвестора в инвестиционном портфеле есть 100 акций компании AMD, стоимостью 50 долл. США за одну акцию. Через день компания AMD публикует сводную финансовую отчетность, и инвестор ожидает, что стоимость акций компаний в первый день вырастет на 13 %. Что инвестору следует предпринять, чтобы застраховать свои риски?	
	купить фьючерсы на акции
	купить опцион покупателя на 100 акций
	купить опцион продавца на 100 акций
	продать все акции в портфеле

#### Задание

Порядковый номер задания	6.
Тип	2
Вес	2

Какие данные не должны быть указаны в контракте опциона на покупку обыкновенных акций?	
	ожидаемая доходность
	место нахождения покупателя
	количество акций
	участники сделки
	вид акций

**Задание**

Порядковый номер задания	7.
Тип	1
Вес	2

<p>В портфеле инвестора было 200 акций ТНК 'Intel', купленных по 63,12 долл. США. Перед презентацией новой линейки продуктов компании инвестор приобрел опцион на покупку 400 акций с ценой исполнения 60 долл. США. После публикации отчетности акции компании стали стоить 65,72 долл. США. Чему равна совокупная доходность инвестора при реализации опциона и продаже всех имеющихся в наличии акций? Транзакционные издержки не учитываются.</p>	
	4,1 %
	13,6 %
	9,5 %
	16,9 %

**Задание**

Порядковый номер задания	8.
Тип	1
Вес	2

<p>В портфеле инвестора было 200 акций ТНК 'Intel', купленных по 50 долл. США. Перед презентацией новой линейки продуктов компании инвестор приобрел опцион на продажу 100 акций с ценой исполнения 60 долл. США. После публикации отчетности акции компании стали стоить 55,42 долл. США. Чему равна совокупная доходность (убыток) инвестора при реализации опциона и продаже всех имеющихся в наличии акций? Транзакционные издержки не учитываются.</p>	
	9,15 %
	5,19 %
	1,95 %
	-5,19 %

**Задание**

Порядковый номер задания	9.
Тип	1
Вес	1

<p>У инвестора в инвестиционном портфеле нет акций компании AMD. Через день компания AMD публикует сводную финансовую отчетность, и инвестор ожидает, что стоимость акций компаний в первый день вырастет на 13 %. Какой опцион инвестору следует купить?</p>	
	опцион покупателя американского типа
	опцион продавца европейского типа
	опцион покупателя европейского типа
	опцион продавца американского типа

**Задание**

Порядковый номер задания	10.
Тип	4
Вес	1

<p>Установленная в контракте опциона цена поставки товара, по которой надписатель опциона обязуется поставить товар в установленный срок, называется ценой _____ опциона.</p>	
<p>_____ экспирации</p>	

**Задание**

Порядковый номер задания	11.
Тип	1
Вес	2

<p>Рыночная стоимость однокомнатной квартиры в Москве составляет 6,8 млн руб. Темп роста стоимости</p>
--

квартиры составляет примерно 6 % годовых. Застройщик планирует построить 200-квартирный дом при инвестировании 1300 млн руб. и продать все квартиры в текущем году. Чему равна предельная стоимость земли (в млн руб.)?	
	80
	70
	60
	90

**Задание**

Порядковый номер задания	12.
Тип	1
Вес	2

Рыночная стоимость однокомнатной квартиры в Москве составляет 6,8 млн руб. Темп роста стоимости квартиры составляет примерно 6 % годовых. Застройщик планирует построить 200-квартирный дом при инвестировании 1300 млн руб. и продать все квартиры в течение двух лет. Чему равна предельная стоимость земли (в млн руб.)?	
	194,6
	141,6
	116,4
	164,1

**Задание**

Порядковый номер задания	13.
Тип	2
Вес	2

Характеристики получаемых оценок предельной стоимости рисковых активов капитала:	
	адаптивность к специфике и особенностям бизнеса
	зависимость от форм и направлений использования активов капитала
	субъективный характер оценки
	зависимость от вероятностей наступления сценариев развития экономики

**Задание**

Порядковый номер задания	14.
Тип	1
Вес	2

Рыночная цена одной квартиры в настоящий период $p = 2000$ тыс. руб.; $a = 1,1$ ; $b = 0,7$ ; $1 - r = 1,3$ ; $C_a = 25$ 000 тыс. руб., $C_b = 15$ 800 тыс. руб. Рассчитайте стоимость эквивалентного портфеля.	
	615
	8615
	6168
	стоимость отрицательная

**Задание**

Порядковый номер задания	15.
Тип	1
Вес	1

Что следует сделать менеджеру в случае, если предлагаемая цена земли меньше рассчитываемой суммы доходов от строительства и продажи квартир?	
	сформировать эквивалентный портфель ценных бумаг
	временно приостановить проект
	отменить инвестиционный проект
	приобрести участок земли

**ПРАКТИКО-ОРИЕНТИРОВАННАЯ ЧАСТЬ ЭКЗАМЕНА**

Вариант 1

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, приведите примеры рисков бизнеса в реальном секторе экономики.

Вариант 2.

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, приведите примеры внешних и внутренних факторов риска.

Вариант 3.

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, дайте характеристику особенностям современной экономики и их влиянию на стратегии развития бизнеса

Вариант 4.

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, назовите основные стратегии развития бизнеса и управления рисками.

Вариант 5.

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, охарактеризуйте аналитический подход к анализу чувствительности.

Вариант 6.

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, расскажите про оценку риска долгосрочного инвестиционного проекта на основе дерева событий.

Вариант 7.

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, расскажите про управление рисками с помощью реальных опционов, встроенных в лизинговый контракт.

Вариант 8.

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, разберите подробно управление рисками в условиях использования лизинга.

Вариант 9.

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, приведите примеры диверсификации на основе производства взаимозаменяемых товаров.

Вариант 10.

Демонстрируя способность применять в профессиональной деятельности методы анализа поведения экономических агентов, приведите примеры диверсификации на основе производства взаимодополняемых товаров.

## ПЕРЕЧЕНЬ ЭКЗАМЕНАЦИОННЫХ ВОПРОСОВ

### Электронное тестирование

#### Задание

Порядковый номер задания	1
Тип	2
Вес	1

Почему инвестиции в исследования и разработки обладают высоким уровнем риска?	
	доступ к интеллектуальным ресурсам затруднен
	патент на изобретение могут не выдать
	обычно они не приносят доходов
	обычно они не окупаются
	требуются сравнительно высокие первоначальные вложения

Порядковый номер задания	2
Тип	2
Вес	2

Отметьте практические способы обоснования рискованных решений компанией:	
	нахождение критериев оценки рискованных решений
	применение методов управления рисками

	воспроизведение всех решений фирмы – лидера на рынке в собственной практике
	моделирование распределений будущих результатов

Порядковый номер задания	3
Тип	2
Вес	2

Чем определяется уровень предпринимательского риска в реальном секторе экономики?	
	методом измерения риска
	сферой деятельности
	ожиданиями и представлениями предпринимателя
	объективно существующей неопределенностью будущих результатов

Порядковый номер задания	4
Тип	2
Вес	2

Какие модели измерения рисков учитывают вероятности, установленные субъективно?	
	АРТ
	дискретная вероятностная модель
	экспертное построение распределения
	САРМ

Порядковый номер задания	5
Тип	1
Вес	1

Кто не исследовал природу риска?	
	Ф. Найт
	Р. Рутнер
	Р. Денк
	Ф. Бэкон

Порядковый номер задания	6
Тип	2
Вес	2

Укажите основные причины неопределенности результатов деятельности организации:	
	случайность в реализации факторов
	появление неизвестных факторов
	отсутствие планового ценообразования
	асимметрия информации
	противодействие конкурентов

Порядковый номер задания	7
Тип	1
Вес	1

Для какого сектора экономики риск бизнеса в широком смысле означает неоднозначную определенность получения будущих доходов под влиянием всей совокупности определяющих их внутренних и внешних факторов?	
	высокотехнологичного
	реального
	фармацевтического
	финансового

Порядковый номер задания	8
Тип	4
Вес	1

В случае, когда менеджер анализирует риск портфеля материальных инвестиционных проектов фирмы и его интересует, каков будет риск исследуемого инвестиционного проекта, если данный проект будет включен в состав этого портфеля, ему следует выявить _____ риск инвестиционного проекта.
корпоративный

Порядковый номер задания	9
Тип	2
Вес	2

Какие особенности учета риска бизнеса подходят для предприятий реального сектора экономики?	
	отсутствие данных о прошлом развитии аналогичных производств
	ускоренная реакция бизнеса на изменения во внешней среде
	специфическая экономическая интерпретация
	распределение будущих полезных результатов

Порядковый номер задания	10
Тип	3
Вес	2

Классифицируйте факторы риска по группам.	
внешние	Внеэкономические факторы Перспективная политика конкурентов Рыночные факторы
внутренние	Финансовое состояние организации Уровень квалификации персонала Просчеты менеджеров

Порядковый номер задания	11
Тип	2
Вес	2

К каким последствиям приводит рост инфляции?	
	рост расходов на заработную плату
	отток капитала из страны
	увеличение процентных ставок по кредитам
	замедление развития предприятий – экспортеров

Порядковый номер задания	12
Тип	2
Вес	2

Отметьте внешние факторы риска:	
	валютный риск
	риск простоя оборудования
	риск изменения цен
	кредитный риск

Порядковый номер задания	13
Тип	2
Вес	2

Что не является внешними факторами риска?	
	инфляция
	финансовая устойчивость
	обменный курс
	ликвидность
	ставка процента

Порядковый номер задания	14
Тип	2

Вес	2
-----	---

Чем определяются производственные факторы риска?	
	взаимоотношениями в коллективе
	особенностями отрасли бизнеса
	организацией менеджмента организации
	политикой процентных ставок
	стадией жизненного цикла организации

Порядковый номер задания	15
Тип	2
Вес	2

Что не является внутренними факторами риска?	
	Природно-климатические факторы
	риск ответственности
	техничко-технологические факторы
	вероятность потери имущества

Порядковый номер задания	16
Тип	4
Вес	1

Реальные ставки процента учитываются в процессе выбора и оценки инвестиционных проектов по критерию <u>                  </u> чистой <u>                  </u> стоимости бизнеса в реальном секторе экономики. <u>                  </u> максимизации <u>                  </u> приведенной	
---	--

Порядковый номер задания	17
Тип	2
Вес	2

Какие особенности риска и характеризующие усиление его влияния на бизнес направления выделяет А. Дамодаран?	
	риск приобрел глобальный характер
	дополнительный риск в ведении бизнеса – результат функционирования финансовых рынков
	риск оказывает влияние на результаты деятельности предприятий во всех сферах без исключений
	эффекты рисков складываются, а общий риск оказывает гораздо более сильное воздействие на ведение бизнеса, чем сумма отдельно рассматриваемых рисков

Порядковый номер задания	18
Тип	2
Вес	2

Отметьте стратегии развития бизнеса в реальном секторе экономики:	
	ориентация на развитие разработки и производства современной техники и технологий
	сохранение видов выпускаемой продукции и удержание позиций на рынке
	продвижение инновационных разработок на внутреннем и внешнем рынках, а также укрепление позиций бизнеса на этих рынках
	переориентация основной деятельности компании на высокотехнологичную, например, с использованием блокчейн-технологий

Порядковый номер задания	19
Тип	2
Вес	2

Какими условиями определяется тип рисковых решений для реального бизнеса?	
	полом менеджера или собственника капитала
	выбранной стратегией развития
	ожиданиями менеджера или собственника капитала о развитии рынка

	склонностью или несклонностью менеджера к принятию рискованных решений
--	--

Порядковый номер задания	20
Тип	2
Вес	2

Отметьте ценные бумаги, используемые при передаче риска изменения цен:	
	облигации
	опционы
	чеки
	ваучеры
	фьючерсы

Порядковый номер задания	21
Тип	2
Вес	2

Что не входит в перечень методов управления рисками бизнеса?	
	создание резервов капитала
	принятие риска на себя
	продажа неликвидных активов
	передача риска

Порядковый номер задания	22
Тип	4
Вес	1

Смена кривой дохода по исходному поколению техники на кривую дохода по новому поколению техники иллюстрирует _____ разрыв.
технологический

Порядковый номер задания	23
Тип	4
Вес	1

На протяжении всей второй половины XX и начала XXI в. закономерность научного прогресса состоит в _____ жизненных циклов внедряемых нововведений и инноваций по различным отраслям и сферам экономики.
сокращения

Порядковый номер задания	24
Тип	4
Вес	1

Наибольшие финансовые результаты менеджер организации планирует получить при реализации _____ стратегии принятия рискованных решений.
атакующей

Порядковый номер задания	25
Тип	1
Вес	1

Какому из состояний экономики соответствует удорожание кредита?	
	экономическому спаду
	подъему хозяйственной конъюнктуры
	сохранению экономического положения
	всем указанным состояниям

Порядковый номер задания	26
--------------------------	----

Тип	3
Вес	2

Сопоставьте виды инвестиций с премиями за риск, которые им соответствуют.	
Инвестиции в фундаментальные исследования	15 % премия за риск
Инвестиции с целью поглощения других фирм	20 % премия за риск
Инвестиции в оборудование	нулевая премия за риск

Порядковый номер задания	27
Тип	3
Вес	3

Поставьте стадии аналитической работы в порядке проведения анализа чувствительности методом Монте-Карло.	
1	определение характеристик распределения чистой настоящей стоимости проекта
2	определение факторов риска
3	определение основных показателей оценки инвестиционного проекта
4	выбор формы распределения случайных величин
5	имитационное моделирование случайных величин

Порядковый номер задания	28
Тип	1
Вес	1

Какой вид анализа чувствительности предусматривает моделирование пошагового изменения параметров компонентов денежного потока инвестиционного проекта?	
	дискретный
	аналитический
	метод Монте-Карло
	все ответы верны

Порядковый номер задания	29
Тип	1
Вес	2

Первоначальные вложения в инвестиционный проект составляют 1 млн руб. Каждый месяц инвестиционный проект приносит доход в размере 53 648 рублей. Предположим, что ставка инфляции составляет 8 % годовых. Через сколько месяцев инвестиции в проект окупятся?	
	18
	16
	20
	22

Порядковый номер задания	30
Тип	1
Вес	2

Первоначальные вложения в инвестиционный проект составляют 1 млн руб. Каждый месяц инвестиционный проект приносит доход в размере 53 648 рублей. Предположим, что ставка инфляции составляет 8 % годовых. Чему равна чистая приведенная стоимость проекта через 3 месяца после первоначального вложения?	
	-841 179 руб.
	-879 419 руб.
	-891 714 руб.
	-819 741 руб.

Порядковый номер задания	31
Тип	1
Вес	1

Первоначальные вложения в инвестиционный проект составляют 1 млн руб. Каждый месяц инвестиционный проект приносит доход в размере 53 648 рублей. Предположим, что ставка инфляции составляет 8 % годовых. При каком изменении ежегодного дохода инвестиционный проект окупится быстрее сравнительно со всеми остальными вариантами?	
	уменьшенном на 3,27 %
	увеличенном на 7,71 %
	увеличенном на 15,21 %
	увеличенном на 11,45 %

Порядковый номер задания	32
Тип	1
Вес	2

Первоначальные вложения в инвестиционный проект составляют 1 млн руб. Каждый месяц инвестиционный проект приносит доход в размере 53 648 рублей. Предположим, что ставка инфляции составляет 8 % годовых. При каком изменении входных параметров инвестиционный проект окупится быстрее сравнительно со всеми остальными вариантами?	
	увеличенном на 15,21 % при повышении ставки инфляции на 2 %
	увеличенном на 11,45 % при снижении ставки инфляции на 1 %
	увеличенном на 7,71 % при снижении ставки инфляции на 6 %
	уменьшенном на 3,27 % при снижении ставки инфляции на 7,5 %

Порядковый номер задания	33
Тип	2
Вес	2

Отметьте условия полного представления результатов анализа чувствительности:	
	значения каждого параметра денежного потока дискретны
	значения каждого параметра денежного потока непрерывны
	все интервалы значений параметров денежных потоков строго ограничены
	число вариантов конечно

Порядковый номер задания	34
Тип	2
Вес	2

Какие предположения делаются аналитиком при использовании в анализе чувствительности метода Монте-Карло?	
	компьютерное моделирование проводится на основе генераторов псевдослучайных чисел
	будущие случайные результаты нормально распределены
	значения всех параметров известны
	параметры денежных потоков изменчивы

Порядковый номер задания	35
Тип	4
Вес	1

При положительной _____ стоимости проекта индекс доходности _____ единицы. чистой настоящей, больше
--

Порядковый номер задания	36
Тип	2
Вес	2

Какие методы не используют в расчете уровня риска проектов долгосрочных инвестиций?	
	метод дерева событий
	метод Монте-Карло
	метод сценариев
	метод экспертных оценок

Порядковый номер задания	37
Тип	2
Вес	2

В каких случаях оценка риска долгосрочного инвестиционного проекта осуществляется методом дерева событий?	
	спрос на производимый товар или оказываемую услугу меняется каждый рассматриваемый период
	ставка дисконтирования изменяется каждый рассматриваемый период
	банковская ставка по кредиту изменяется каждый рассматриваемый период
	доходность проектов при различных вариантах течения событий существенно изменяется

Порядковый номер задания	38
Тип	2
Вес	2

Какие предположения делаются аналитиком при оценке риска методом сценариев?	
	в процессе реализации инвестиционного проекта варианты его развития не изменяются
	сегменты рынка для сбыта продукции определены и неизменны
	вся неопределенность будущего развития инвестиционного проекта исчисляется несколькими вариантами
	параметры денежных потоков инвестиционного проекта изменчивы

Порядковый номер задания	39
Тип	3
Вес	3

Поставьте этапы построения дерева решений в соответствии с концепцией А. Дамодарана.	
1	оценка вероятностей исходов на каждом этапе проекта
2	распределение значений NPV проекта при прохождении дерева решений в обратном порядке
3	построение денежных потоков, которые соответствуют каждому конечному узлу рассматриваемого дерева решений
4	определение основных критериев принятия решений
5	выделение особенностей оценки риска на каждом этапе проекта

Порядковый номер задания	40
Тип	2
Вес	1

Отметьте меры риска инвестиционного проекта:	
	ожидаемое значение NPV
	коэффициент ковариации
	уровень дисперсии
	стандартное отклонение

Порядковый номер задания	41
Тип	4
Вес	1

Относительное увеличение зарплатоемкости продукции предполагает _____ конъюнктура рынка. неблагоприятная
---

Порядковый номер задания	42
Тип	2
Вес	2

Отметьте основные разновидности решений по управлению инвестиционным риском:	
	получение сравнительно более надежной информации о перспективах осуществления инвестиционного проекта
	прекращение реализации проекта
	изменение параметров денежного потока инвестиционного проекта

изменение метода расчета ставки дисконтирования
---

Порядковый номер задания	43
Тип	4
Вес	1

Если чистая приведенная стоимость инвестиционного проекта приобретает отрицательное значение, то проект следует _____.
отклонить

Порядковый номер задания	44
Тип	4
Вес	1

В управлении рисками бизнеса решение не может быть принято без участия _____.
собственника капитала

Порядковый номер задания	45
Тип	4
Вес	1

В случае принятия решения о досрочном прекращении инвестиционного проекта организация реализует _____ стратегию управления рисками.
защитную

Порядковый номер задания	46
Тип	1
Вес	3

Первоначальные вложения в инвестиционный проект составляют 1 млн руб. Каждый месяц инвестиционный проект приносит доход в размере 53 648 рублей. Предположим, что ставка инфляции составляет 8 % годовых. Для повышения эффективности проекта компания решила вложить в первый месяц 500 тыс. руб. в рекламу, а во второй – 300 тыс. руб. На третий месяц инвестиционный проект должен приносить на 15,21 % больше. Через сколько месяцев инвестиции в проект окупятся?
24
20
18
22

Порядковый номер задания	47
Тип	2
Вес	2

Отметьте формы управления рисками посредством диверсификации:
несколько правильных ответов
приобретение новых производств
реструктуризация бизнеса
инвестиции в исследования и разработки
изменение структуры портфеля ценных бумаг

Порядковый номер задания	48
Тип	1
Вес	1

Как выглядит формула предельной платы за реальный опцион, если ожидаемое значение NPV исходного проекта принимает отрицательное значение?
$R_{пред} = NPV2 - NPV1$
$R_{пред} = NPV2$
$R_{пред} = NPV1$
$R_{пред} = NPV1 - NPV2$

Порядковый номер задания	49
Тип	2
Вес	2

Какие факторы не учитываются при оценке стоимости реальных опционов?	
	ставка дисконтирования
	денежные потоки по инвестиционному проекту
	условия исполнения опциона
	места нахождения покупателя и продавца
	уровень прибыли организации – покупателя опциона

Порядковый номер задания	50
Тип	1
Вес	2

Какие опционы имеют характер индивидуальной двусторонней сделки?	
	комплексные реальные
	встроенные реальные
	свопционы
	контрактные реальные

## 8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### 8.1. Рекомендуемая литература

#### Основная литература

1. Калмыкова, О. Ю. Управление кадровыми рисками в организации : учебное пособие / О. Ю. Калмыкова, Н. В. Соловова, Т. С. Латушкина. — Самара : Самарский государственный технический университет, ЭБС АСВ, 2018. — 162 с. — ISBN 978-5-7964-2106-2. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/90964.html>
2. Панягина, А. Е. Управление рисками на предприятии: теория и практика : учебное пособие / А. Е. Панягина, А. В. Свистунов. — Москва : Ай Пи Ар Медиа, 2020. — 284 с. — ISBN 978-5-4497-0608-9. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/96561.html>
3. Дубина, И. Н. Основы управления рисками : учебное пособие / И. Н. Дубина, Г. К. Кишибекова. — Саратов : Вузовское образование, 2018. — 266 с. — ISBN 978-5-4487-0271-6. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/76240.html>

#### Дополнительная литература

1. Рахимова, Н. Н. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебное пособие / Н. Н. Рахимова. — Оренбург : Оренбургский государственный университет, ЭБС АСВ, 2016. — 191 с. — ISBN 978-5-7410-1538-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/69961.html>
2. Кулешова, Е. В. Управление рисками проектов : учебное пособие / Е. В. Кулешова. — 2-е изд. — Томск : Томский государственный университет систем управления и радиоэлектроники, Эль Контент, 2015. — 188 с. — ISBN 978-5-4332-0251-1. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/72205.html>

### 8.2. Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

1. <https://www.e-executive.ru/>
2. <https://www.pwc.ru/>
3. <https://finacademy.net/>
4. <https://habr.com/>
5. <https://www.riskstrategy.ru/>
6. <https://www.cfin.ru/>
7. <http://www.risk24.ru/>
8. <https://www2.deloitte.com/ru/ru/pages/risk/topics/risk-advisory.html>
9. <https://www.nsd.ru/about/korporativnoe-upravlenie/sistema-upravleniya-riskami/>
10. <http://www.iccwbo.ru/blog/2016/upravlenie-riskami-v-organizatsii/>

## 9. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине представлено в приложении 7 «Сведения о материально-техническом обеспечении программы высшего образования – программы магистратуры направления подготовки 38.04.01 «Экономика».

#### **10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая программное обеспечение, современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы**

Программное обеспечение АНО ВО ОУЭП, являющееся частью электронной информационно-образовательной среды и базирующееся на телекоммуникационных технологиях:

- тренинговые и тестирующие программы;
- интеллектуальные роботизированные системы оценки качества выполнения работ.

Информационные и роботизированные системы, программные комплексы, программное обеспечение для доступа к компьютерным обучающим, тренинговым и тестирующим программам:

- ПК «КОП»;
- ИР «Каскад».

Программное обеспечение, необходимое для реализации дисциплины:

*Лицензионное программное обеспечение (в том числе, отечественного производства):*

Операционная система Windows Professional 10

ПО браузер – приложение операционной системы, предназначенное для просмотра Web-страниц

Платформа проведения аттестационных процедур с использованием каналов связи (отечественное ПО)

Платформа проведения вебинаров (отечественное ПО)

Информационная технология. Онлайн тестирование цифровой платформы Роверб (отечественное ПО)

Электронный информационный ресурс. Экспертный интеллектуальный информационный робот

Аттестация ассессоров (отечественное ПО)

Информационная технология. Аттестационный интеллектуальный информационный робот контроля оригинальности и профессионализма «ИИР КОП» (отечественное ПО)

Электронный информационный ресурс «Личная студия обучающегося» (отечественное ПО)

*Свободно распространяемое программное обеспечение (в том числе отечественного производства):*

Мой Офис Веб-редакторы <https://edit.myoffice.ru> (отечественное ПО)

ПО OpenOffice.Org Calc.

[http://qsp.su/tools/onlinehelp/about\\_license\\_gpl\\_russian.html](http://qsp.su/tools/onlinehelp/about_license_gpl_russian.html)

ПО OpenOffice.Org.Base

[http://qsp.su/tools/onlinehelp/about\\_license\\_gpl\\_russian.html](http://qsp.su/tools/onlinehelp/about_license_gpl_russian.html)

ПО OpenOffice.org.Impress

[http://qsp.su/tools/onlinehelp/about\\_license\\_gpl\\_russian.html](http://qsp.su/tools/onlinehelp/about_license_gpl_russian.html)

ПО OpenOffice.Org Writer

[http://qsp.su/tools/onlinehelp/about\\_license\\_gpl\\_russian.html](http://qsp.su/tools/onlinehelp/about_license_gpl_russian.html)

ПО Open Office.org Draw

[http://qsp.su/tools/onlinehelp/about\\_license\\_gpl\\_russian.html](http://qsp.su/tools/onlinehelp/about_license_gpl_russian.html)

ПО «Блокнот» - стандартное приложение операционной системы (MS Windows, Android и т.д.), предназначенное для работы с текстами;

*Современные профессиональные базы данных:*

Реестр профессиональных стандартов <https://profstandart.rosmintrud.ru/obshchiy-informatsionnyy-blok/natsionalnyy-reestr-professionalnykh-standartov/reestr-professionalnykh-standartov/>

Реестр студентов/ординаторов/аспирантов/ассистентов-стажеров <https://www.mos.ru/karta-moskvicha/services-proverka-grazhdanina-v-reestre-studentov/>

Российский Союз аудиторов - <https://org-rsa.ru/>

Ассоциация российских банков - <https://arb.ru/>

Бухгалтерия.ру - <https://www.buhgalteria.ru/>

Союз финансистов России - <http://sf-rf.ru/>

Научная электронная библиотека. <http://elibrary.ru>

Электронно-библиотечная система IPRbooks (ЭБС IPRbooks) –

электронная библиотека по всем отраслям знаний

<http://www.iprbookshop.ru>

*Информационно-справочные системы:*

Справочно-правовая система «Гарант»;

Справочно-правовая система «Консультант Плюс».