

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ  
ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования

«КУБАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

Факультет экономический

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной работе,  
качеству образования – первый  
проректор



Хагуров Т.А.

«30» мая 2025г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

**Б1.В.17 РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ В ПРОЕКТНОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ**

Направление подготовки \_\_\_\_\_ 38.04.02 Менеджмент

Направленность (профиль) \_\_\_\_\_ Управление проектами и бизнес-процессами

Форма обучения \_\_\_\_\_ очная, заочная

Квалификация \_\_\_\_\_ магистр

Краснодар 2025

## **1 Цели и задачи изучения дисциплины (модуля)**

### **1.1 Цель освоения дисциплины**

Целью дисциплины «Риск-менеджмент в проектной деятельности» является приобретение обучающимися навыков формирования наиболее эффективных вариантов строения системы управления, функционирования и развития в проектной деятельности.

Выполнение программы «Риск-менеджмент в проектной деятельности» предполагает не только освоение теоретических знаний в данной области, но и получение конкретных практических навыков, направленных на укрепление знаний в представленной научной сфере. Для этого планируются лекции, практические и семинарские занятия, круглые столы с последующим обсуждением и подведением итогов, написание эссе и других письменных работ.

### **1.2 Задачи дисциплины**

1. Изучение и применение на практике основных функций менеджмента;
2. Изучить понятийный аппарат и содержание риск-менеджмента;
3. Рассмотреть законы и принципы риск-менеджмента;
4. Изучить методологию риск-менеджмента;
5. Освоить стратегию, политику и тактику риск-менеджмента;
6. Проводить анализ и оценку рисков и методов управления ими;
7. Овладеть навыками применения научных приемов снижения рисков в проектной деятельности;
8. Принимать оперативные управленческих решений.

### **1.3 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы**

Дисциплина «Риск-менеджмент в проектной деятельности» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 Дисциплины (модули) учебного плана.

В соответствии с рабочим учебным планом дисциплина изучается на 2 курсе по заочной форме обучения. Вид промежуточной аттестации: экзамен.

Для освоения курса студенты должны владеть компетенциями, полученными при изучении смежных дисциплин: «Современные теории и практики управления», «Управление проектной деятельностью», «Финансово-экономическое обеспечение проектного менеджмента».

### **1.4 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы**

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Код и наименование индикатора* достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
<b>УК-1</b> Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	
ИУК-1.2 Вырабатывает стратегию действий для решения проблемной ситуации	ИУК-1.2. 3-1. Знает принципы, критерии, правила построения стратегии действий для решения проблемных ситуаций
	ИУК-1.2. У-1. Умеет формировать собственную стратегию действий для решения проблемной ситуации, грамотно и логично аргументируя свою точку зрения

Код и наименование индикатора* достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
	ИУК-1.2. У-2. Умеет находить, анализировать и выбирать информацию, необходимую для выработки стратегии действий по решению проблемной ситуации.
	ИУК-1.2. У-3. Умеет применять теоретические знания в решении практических задач
<b>ПК-2 Способен управлять инвестиционным проектом</b>	
ИПК-2.1 Применяет инструментарий исследования и управления эффективностью инвестиционного проекта	ИПК-2.1. 3-1. Знает количественные и качественные методы исследований в управлении эффективностью инвестиционного проекта.
	ИПК-2.1. У-1. Умеет выявлять данные, необходимые для решения поставленных исследовательских задач в управлении эффективностью инвестиционного проекта.
	ИПК-2.1. У-2. Умеет применять методы экономического и стратегического анализа для исследования инвестиционного проекта
ИПК-2.3 Выявляет, анализирует, разрабатывает мероприятия по снижению рисков инвестиционного проекта	ИПК-2.3. 3-1 Знает методы количественной и качественной оценки риска.
	ИПК-2.3. У-1 Умеет применять стратегию и тактику риск-менеджмента.
	ИПК-2.3. У-2 Умеет выявлять и формулировать стратегические альтернативы по снижению рисков.
	ИПК-2.3. В-1 Владеет теорией и практикой разработки мероприятий по снижению рисков инвестиционного проекта.
ИПК-2.4 Понимает условия реализации инвестиционного проекта, может применять знания технологий контроля и управления сроками реализации инвестиционного проекта	ИПК-2.4. 3-1 Знает общую схему процесса принятия решений, виды и особенности задач принятия решений для реализации инвестиционного проекта.
	ИПК-2.4. У-1 Умеет применять знания технологий контроля и управления сроками реализации инвестиционного проекта.
<b>ПК-3 Способен проектировать и внедрять системы процессного управления организации</b>	
ИПК-3.3 Исследует системы процессного управления организации и разрабатывает проект по её внедрению или усовершенствованию	ИПК-3.3. 3-1 Способен выбирать инструментальные средства, современные технические средства и информационные технологии для обработки информации в соответствии с поставленной научной задачей в сфере управления.
	ИПК-3.3. У-1 Умеет проводить самостоятельные исследования процессного управления с использованием современных информационных технологий.
	ИПК-3.3. У-2 Умеет разрабатывать проект по внедрению или усовершенствованию процессного управления.

Код и наименование индикатора* достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
ИПК-3.5 Разрабатывает предложения по устранению и (или) предупреждению выявленных причин отклонений в системе процессного управления	ИПК-3.5. 3-1 Знает современную классификацию методов в системе процессного управления.
	ИПК-3.5. У-1 Умеет использовать инструменты диагностики состояния объектов управления.
	ИПК-3.5. У-2 Умеет выявлять причины отклонений и разрабатывать предложения по предотвращению их негативного воздействия.
<b>ПК-4 Способен проектировать и трансформировать процессную архитектуру организации</b>	
ИПК-4.4 Разрабатывает методики и регламенты трансформации процессной архитектуры организации	ИПК-4.4 3-1 Знает методики трансформации процессной архитектуры организации.
	ИПК-4.4 У-1 Умеет анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы в соответствии с поставленной научной задачей в процессной архитектуре организации.

Результаты обучения по дисциплине достигаются в рамках осуществления всех видов контактной и самостоятельной работы обучающихся в соответствии с утвержденным учебным планом.

Индикаторы достижения компетенций считаются сформированными при достижении соответствующих им результатов обучения.

## 2. Структура и содержание дисциплины

### 2.1 Распределение трудоёмкости дисциплины по видам работ

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 4 зачетных единиц (144 часов), их распределение по видам работ представлено в таблице

Виды работ	Всего часов	Форма обучения			
		очная		очно-заочная	заочная
		Х семестр (часы)	Х семестр (часы)	Х семестр (часы)	2 курс (часы)
<b>Контактная работа, в том числе:</b>	<b>16,3</b>				<b>16,3</b>
<b>Аудиторные занятия (всего):</b>	<b>16</b>				<b>16</b>
занятия лекционного типа	4				4
лабораторные занятия					
практические занятия	12				12
семинарские занятия					
<b>Иная контактная работа:</b>	<b>0,3</b>				<b>0,3</b>
Контроль самостоятельной работы (КСР)					
Промежуточная аттестация (ИКР)	0,3				0,3
<b>Самостоятельная работа, в том числе:</b>	<b>119</b>				<b>119</b>
Контрольная работа	39				39
Реферат/эссе (подготовка)	30				30
Самостоятельное изучение разделов, самоподготовка (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных	30				30

пособий, подготовка к лабораторным и практическим занятиям, коллоквиумам и т.д.)					
Подготовка к текущему контролю		30			30
<b>Контроль:</b>		<b>8,7</b>			<b>8,7</b>
Подготовка к экзамену					
<b>Общая трудоемкость</b>	<b>час.</b>	<b>144</b>			<b>144</b>
	<b>в том числе контактная работа</b>	<b>16,3</b>			<b>16,3</b>
	<b>зач. ед</b>	<b>4</b>			<b>4</b>

## 2.2 Содержание дисциплины

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.  
Разделы (темы) дисциплины, изучаемые на 2 курсе (заочная)

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1.	Предпосылки возникновения риска. Неопределенность и угрозы	10,5	0,5	1		9
2.	Сущность, объекты, субъекты и функции риска	13,5	0,5	1		12
3.	Современное понимание методов управления проектами	20,5	0,5	2		18
4.	Управление рисками проекта	24,5	0,5	2		22
5.	Анализ и оценка рисков	24,5	0,5	2		22
6.	Методы управления рисками	20,5	0,5	2		18
7.	Принятие решений в условиях определенности, риска и неопределенности	21	1	2		18
<b>ИТОГО по разделам дисциплины</b>			<b>4</b>	<b>12</b>		<b>119</b>
Контроль самостоятельной работы (КСР)						
Промежуточная аттестация (ИКА)		0,3				
Подготовка к текущему контролю		8,7				
Общая трудоемкость по дисциплине		144				

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия / семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

## 2.3 Содержание разделов (тем) дисциплины

### 2.3.1 Занятия лекционного типа

№	Наименование раздела (темы)	Содержание раздела (темы)	Форма текущего контроля
1.	Предпосылки возникновения риска. Неопределенность и угрозы	Эволюция опасностей и совершенствование технологий защиты. Неопределенность. Угрозы и опасности, их виды.	<i>P</i>

2.	Сущность, объекты, субъекты и функции риска	Сущность риска. Риск и шанс. Объекты и субъекты риска. Функции риска	<i>T</i>
3.	Классификация рисков	Классификация рисков. Экономические риски и убытки. Предпринимательские риски как особая категория рисков.	<i>T, P</i>
4.	Управление рисками проекта	Историческое развитие риск-менеджмента. Построение системы управления рисками. Методология управления рисками	<i>P</i>
5.	Анализ и оценка рисков	Стандарты в риск-менеджменте. Анализ и оценка рисков. Методы расчета рисков. Оценка рисков. Приемлемость риска	<i>Э</i>
6.	Методы управления рисками	Классификация методов управления рисками. Уклонение от риска. Уменьшение риска. Передача риска. Удержание риска. Учет рисков при финансировании проекта. Страхование рисков, хеджирование. Пути снижения внутренних предпринимательских рисков	<i>P</i>
7.	Принятие решений в условиях определенности, риска и неопределенности	Общая схема процесса принятия решения. Особенности принятия решений в управлении. Модели принятия решений. Методы принятия решений	<i>T, Э</i>

### 2.3.2 Занятия семинарского типа (практические / семинарские занятия/ лабораторные работы)

№	Наименование раздела (темы)	Тематика занятий/работ	Форма текущего контроля
1.	Предпосылки возникновения риска. Неопределенность и угрозы	Эволюция опасностей и совершенствование технологий защиты. Изменение состояния объекта. Неопределенность. Причины и виды неопределенности. Рискология. Риск-менеджмент. Понятие угрозы и опасности, их виды. Факторы риска.	<i>P</i>
2.	Сущность, объекты, субъекты и функции риска	Сущность и элементы риска. Риск и шанс. Объекты и субъекты риска. Функции риска. Классификация объектов риска. Субъекты риска.	<i>T</i>
3.	Классификация рисков	Классификация рисков по сфере возникновения. Классификация рисков по периоду существования. Экономические риски и убытки. Предпринимательские риски как особая категория рисков. Классификация рисков по различным критериям. Концепция предпринимательского риска. Виды потерь.	<i>T, P</i>
4.	Управление рисками проекта	Эволюция понятия «менеджмент». Историческое развитие риск-менеджмента. Построение системы риск-менеджмента. Структурная схема циркулирования информации. Политика риска. Характеристики системы управления рисками. Методология управления рисками. Стратегия и тактика риск-менеджмента. Схема организации риск-менеджмента.	<i>P</i>

5.	Анализ и оценка рисков	Стандарты в риск-менеджменте. Модель внутрифирменного стандарта риск-менеджмента. Анализ и оценка рисков. Идентификация рисков. Количественная и качественная оценка риска. Структура методов экспертных оценок. Блок-схема анализа риска. Форма описания рисков. Методы расчета рисков. Оценка рисков. Приемлемость риска. Зоны риска и их связь с планированием. Кривая риска.	Э
6.	Методы управления рисками	Классификация методов управления рисками. Уклонение от риска. Уменьшение риска. Передача риска. Удержание риска. Направления самострахования. Методы нейтрализации рисков. Учет рисков при финансировании проекта. Страхование рисков, хеджирование. Пути снижения внутренних предпринимательских рисков.	Р
7.	Принятие решений в условиях определенности, риска и неопределенности	Общая схема процесса принятия решения. Виды и особенности задач принятия решений. Особенности принятия решений в управлении. Модели принятия решений: теория игр, модели теории очередей, модели управления запасами, модели линейного программирования, транспортные задачи, сетевой анализ, экономический анализ. Методы принятия решений.	Т, Э

Защита лабораторной работы (ЛР), выполнение курсового проекта (КП), курсовой работы (КР), расчетно-графического задания (РГЗ), написание реферата (Р), эссе (Э), коллоквиум (К), тестирование (Т) и т.д.

При изучении дисциплины могут применяться электронное обучение, дистанционные образовательные технологии в соответствии с ФГОС ВО.

### 2.3.3 Примерная тематика курсовых работ (проектов)

Курсовые работы не предусмотрены учебным планом.

### 2.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

№	Вид СРС	Перечень учебно-методического обеспечения дисциплины по выполнению самостоятельной работы
1	Занятия лекционного и семинарского типа	Методические указания для подготовки к занятиям лекционного и семинарского типа. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года.. Режим доступа: <a href="https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya">https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya</a>
2	Подготовка эссе, рефератов, курсовых работ.	Методические указания для подготовки эссе, рефератов, курсовых работ. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ».

		Протокол № 1 от 30 августа 2018 года.. Режим доступа: <a href="https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya">https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya</a>
3	Выполнение самостоятельной работы обучающихся	Методические указания по выполнению самостоятельной работы обучающихся. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года.. Режим доступа: <a href="https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya">https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya</a>
4	Выполнение расчетно-графических заданий	Методические указания по выполнению расчетно-графических заданий. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года.. Режим доступа: <a href="https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya">https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya</a>
5	Интерактивные методы обучения	Методические указания по интерактивным методам обучения. Утверждены на заседании Совета экономического факультета ФГБОУ ВО «КубГУ». Протокол № 1 от 30 августа 2018 года. Режим доступа: <a href="https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya">https://www.kubsu.ru/ru/econ/metodicheskie-ukazaniya</a>

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся из числа инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья (ОВЗ) предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

- в печатной форме увеличенным шрифтом,
- в форме электронного документа,
- в форме аудиофайла,
- в печатной форме на языке Брайля.

Для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа,
- в форме аудиофайла.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

### **3. Образовательные технологии, применяемые при освоении дисциплины (модуля)**

В ходе изучения дисциплины предусмотрено использование следующих образовательных технологий: лекции, практические занятия, проблемное обучение, модульная технология, подготовка письменных аналитических работ, самостоятельная работа студентов.

Компетентностный подход в рамках преподавания дисциплины реализуется в использовании интерактивных технологий и активных методов (проектных методик, мозгового штурма, разбора конкретных ситуаций, иных форм) в сочетании с внеаудиторной работой.

Информационные технологии, применяемые при изучении дисциплины: использование информационных ресурсов, доступных в информационно-телекоммуникационной сети Интернет.

Адаптивные образовательные технологии, применяемые при изучении дисциплины – для лиц с ограниченными возможностями здоровья предусмотрена организация консультаций с использованием электронной почты.



#### 4. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

Оценочные средства предназначены для контроля и оценки образовательных достижений обучающихся, освоивших программу учебной дисциплины «*Организационное поведение*».

Оценочные средства включает контрольные материалы для проведения **текущего контроля** в форме *тестовых заданий, доклада-презентации по проблемным вопросам, разноуровневых заданий, ролевой игры, ситуационных задач (указать иное)* и **промежуточной аттестации** в форме вопросов и заданий к экзамену.

##### Структура оценочных средств для текущей и промежуточной аттестации

№ п/п	Код и наименование индикатора (в соответствии с п. 1.4)	Результаты обучения (в соответствии с п. 1.4)	Наименование оценочного средства	
			Текущий контроль	Промежуточная аттестация
1	ИУК-1.2 Вырабатывает стратегию действий для решения проблемной ситуации	ИУК-1.2. 3-1. Знает принципы, критерии, правила построения стратегии действий для решения проблемных ситуаций. ИУК-1.2. У-1. Умеет формировать собственную стратегию действий для решения проблемной ситуации, грамотно и логично аргументируя свою точку зрения ИУК-1.2. У-2. Умеет находить, анализировать и выбирать информацию, необходимую для выработки стратегии действий по решению проблемной ситуации. ИУК-1.2. У-3. Умеет применять теоретические знания в решении практических задач	Реферат, опрос	Вопрос на экзамене 1-4
2	ИПК- 2.4 Понимает условия реализации инвестиционного проекта, может применять знания технологий контроля и управления сроками реализации инвестиционного проекта	ИПК-2.4. 3-1 Знает общую схему процесса принятия решений, виды и особенности задач принятия решений для реализации инвестиционного проекта. ИПК-2.4. У-1 Умеет применять знания технологий контроля и управления сроками реализации инвестиционного проекта.	Тест, опрос	Вопрос на экзамене 5-9
3	ИПК- 2.3 Выявляет, анализирует, разрабатывает мероприятия по снижению рисков инвестиционного проекта	ИПК-2.3. 3-1 Знает методы количественной и качественной оценки риска. ИПК-2.3. У-1 Умеет применять стратегию и тактику риск-менеджмента. ИПК-2.3. У-2 Умеет выявлять и формулировать стратегические альтернативы по снижению рисков. ИПК-2.3. В-1 Владеет теорией и практикой разработки мероприятий по	Тест, Реферат	Вопрос на экзамене 10-18

		снижению рисков инвестиционного проекта.		
4	ИПК-2.1 Применяет инструментарий исследования и управления эффективностью инвестиционного проекта	ИПК-2.1. 3-1. Знает количественные и качественные методы исследований в управлении эффективностью инвестиционного проекта. ИПК-2.1. У-1. Умеет выявлять данные, необходимые для решения поставленных исследовательских задач в управлении эффективностью инвестиционного проекта. ИПК-2.1. У-2. Умеет применять методы экономического и стратегического анализа для исследования инвестиционного проекта	Реферат, опрос, практическое задание	Вопрос на экзамене 19-24
5	ИПК- 3.3 Исследует системы процессного управления организации и разрабатывает проект по её внедрению или усовершенствованию	ИПК-3.3. 3-1 Способен выбирать инструментальные средства, современные технические средства и информационные технологии для обработки информации в соответствии с поставленной научной задачей в сфере управления. ИПК-3.3. У-1 Умеет проводить самостоятельные исследования процессного управления с использованием современных информационных технологий. ИПК-3.3. У-2 Умеет разрабатывать проект по внедрению или усовершенствованию процессного управления.	Эссе, опрос	Вопрос на экзамене 25-28
6	ИПК-3.5 Разрабатывает предложения по устранению и (или) предупреждению выявленных причин отклонений в системе процессного управления	ИПК-3.5. 3-1 Знает современную классификацию методов в системе процессного управления. ИПК-3.5. У-1 Умеет использовать инструменты диагностики состояния объектов управления. ИПК-3.5. У-2 Умеет выявлять причины отклонений и разрабатывать предложения по предотвращению их негативного воздействия.	Реферат, практическое задание	Вопрос на экзамене 29-33
7	ИПК-4.4 Разрабатывает методики и регламенты трансформации процессной архитектуры организации	ИПК-4.4 3-1 Знает методики трансформации процессной архитектуры организации. ИПК-4.4 У-1 Умеет анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы в соответствии с поставленной научной задачей в процессной архитектуре организации.	Тест, Эссе	Вопрос на экзамене 34-38

**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**

***Примерный перечень вопросов и заданий***

**Контрольная работа**

**Вариант 1**

1. Особенности управления рисками в проектном менеджменте.
2. Проблемы управления рисками инвестиционных проектов.
3. Перспективы развития управления проектами.

**Вариант 2**

1. Разработка инструментов и методов управления рисками проекта.
2. Обзор методов управления проектными рисками.
3. Система оценки рисков проекта.

**Вариант 3**

1. Управление рисками в программном проекте.
2. Проблемы управления рисками в проектном менеджменте.
3. Пути повышения эффективности механизма управления рисками.

**Реферат**

**Тематика рефератов**

1. Сущность и содержание управления риском.
2. Принятие решения в условиях риска.
3. Процесс управления проектными рисками.
4. Этапы проектного цикла.
5. Концепция минимизации риска.
6. Концепция приемлемого риска.
7. Методы оценки рисков проекта.
8. Управление рисками в течение жизненного цикла проекта.
9. Основные принципы классификации рисков.
10. Классификация проектных рисков.
11. Инструменты управления проектными рисками.
12. Классификация способов воздействия на риск.
13. Методы управления риском.
14. Инструменты управления рисками по фазам проектного цикла.
15. Инструменты управления проектным риском по видам бенефициаров.
16. Страхование проектных рисков.
17. Анализ проектных рисков.
18. Инструменты риск-анализа.
19. Сущность качественного анализа проектных рисков.
20. Методы количественного анализа проектных рисков.
21. Анализ чувствительности проекта.

**Тест**

**Тест №1**

1. Какой из перечисленных методов оценки риска основан на расчетах и анализе статистических показателей?
  - а) вероятностный метод
  - б) построение дерева решений
  - в) метод сценариев

- г) анализ чувствительности
- д) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- е) имитационное моделирование

2. Какой из перечисленных методов оценки риска дает представление о наиболее критических факторах инвестиционного проекта?

- а) построение дерева решений
- б) метод сценариев
- в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- г) вероятностный метод
- д) анализ чувствительности
- е) имитационное моделирование

3. Какой из перечисленных методов оценки риска реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения де-нежных потоков?

- а) построение дерева решений
- б) метод сценариев
- в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- г) анализ чувствительности
- д) вероятностный метод
- е) имитационное моделирование

4. Какой из перечисленных методов оценки риска используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий?

- а) имитационное моделирование
- б) вероятностный метод
- в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- г) построение дерева решений
- д) анализ чувствительности
- е) метод сценариев

5. Какой из перечисленных методов оценки риска представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты?

- а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- б) анализ чувствительности
- в) построение дерева решений
- г) вероятностный метод
- д) метод сценариев
- е) имитационное моделирование

6. Каким образом при расчете чистой приведенной стоимости можно учитывать риск?

- а) в знаменателе формулы NPV посредством корректировки ставки дисконта
- б) комбинация формул NPV посредством корректировки чистых денежных потоков
- в) все варианты верны
- г) в числителе формулы NPV посредством корректировки чистых денежных потоков

7. Что является субъектом управления в риск-менеджменте?

а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

б) все варианты верны

в) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

8. Что является объектом управления в риск-менеджменте?

- а) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами
  - б) все варианты верны
  - в) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками
9. Утверждение о том, что «деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» отражает смысл...
- а) закона неизбежности риска
  - б) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
  - в) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
10. Утверждение о том, что «практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» отражает смысл...
- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
  - б) закона неизбежности риска
  - в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

## Тест №2

1. Утверждение о том, что «чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» отражает смысл...
- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
  - б) закона неизбежности риска
  - в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
2. К какой группе методов управления рисками относится прогнозирование внешней обстановки?
- а) методы компенсации рисков
  - б) методы уклонения от рисков
  - в) методы локализации рисков
  - г) методы диверсификации рисков
3. К какой группе методов управления рисками относится страхование?
- а) методы уклонения от рисков
  - б) методы диверсификации рисков
  - в) методы локализации рисков
  - г) методы компенсации рисков
4. К какой группе методов управления рисками относится распределение риска по этапам работы?
- а) методы локализации рисков
  - б) методы компенсации рисков
  - в) методы уклонения от рисков
  - г) методы диверсификации рисков
5. К какой группе методов управления рисками относится заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов?
- а) методы диверсификации рисков
  - б) методы уклонения от рисков
  - в) методы компенсации рисков
  - г) методы локализации рисков

6. К какой группе методов управления рисками относится обучение и структурирование персонала?
- а) методы уклонения от рисков
  - б) методы компенсации рисков
  - в) методы диверсификации рисков
  - г) методы локализации рисков
7. К какой группе методов управления рисками относится распределение ответственности между участниками проекта?
- а) методы диверсификации рисков
  - б) методы компенсации рисков
  - в) методы локализации рисков
  - г) методы уклонения от рисков
8. К какой группе методов управления рисками относится увольнение некомпетентных сотрудников?
- а) методы локализации рисков
  - б) методы диверсификации рисков
  - в) методы уклонения от рисков
  - г) методы компенсации рисков
9. К какой группе методов управления рисками относится создание системы резервов?
- а) методы уклонения от рисков
  - б) методы диверсификации рисков
  - в) методы компенсации рисков
  - г) методы локализации рисков
10. К какой группе методов управления рисками относится создание специальных инновационных подразделений?
- а) методы локализации рисков
  - б) методы диверсификации рисков
  - в) методы компенсации рисков
  - г) методы уклонения от рисков

### Тест №3

1. Управление риском проекта это
- а) системное применение политики, процедур и методов управления к задачам определения ситуации, идентификации, анализа, оценки, обработки, мониторинга риска и обмена информацией, для обеспечения снижения потерь и увеличения рентабельности.
  - б) системное применение политики, процедур и методов управления целями проекта, анализа, оценки, обработки, мониторинга информацией, для обеспечения снижения потерь и увеличения рентабельности
  - в) системное применение политики, процедур и методов управления командой проекта и обмена информацией, для обеспечения снижения потерь и увеличения рентабельности
  - г) системное применение политики, процедур и методов управления к задачам определения ситуации, мониторинга риска и обмена информацией, для обеспечения снижения потерь.
2. Риск, связанный с возможностью потерь при реализации объекта инвестирования из-за изменения оценки его качества – это
- а) политический риск;
  - б) риск конкурентоспособности;

- в) селективный риск;
- г) риск ликвидности;
- д) риск рентабельности.

3. Риск ухудшения конъюнктуры (падения) какого-либо рынка в целом – это

- а) системный риск;
- б) риск ликвидности;
- в) дефляционный риск;
- г) инфляционный риск;
- д) селективный риск.

4. Риск потерь в процессе финансово-хозяйственной деятельности – это

- а) коммерческий риск;
- б) финансовый риск;
- в) спекулятивные риски;
- г) производственный риск.

5. Процесс снижения риска за счет увеличения разнообразия видов деятельности рынков сбыта или каналов поставок носит название

- а) дифференцирование;
- б) конвергенция;
- в) фокусирование
- г) диверсификация;

6. По характеру последствий риски подразделяются на

- а) чистые и селективные;
- б) производственные и коммерческие;
- в) коммерческие и политические;
- г) чистые и спекулятивные;
- д) прямые и финансовые.

7. Какие риски могут принести дополнительную прибыль фирме?

- а) любые;
- б) спекулятивные;
- в) чистые;
- г) реализация риска в принципе не может принести дополнительную прибыль компании;
- д) ретроспективные.

8. Селективный риск – это:

- а) риск потерь или упущенной выгоды из-за неправильного выбора объекта инвестирования на определенном рынке;
- б) риск, связанный с возможностью потерь при реализации объекта инвестирования из-за изменения оценки его качества;
- в) риск того, что заемщик (должник) окажется не в состоянии выполнить свои обязательства.

9. Методы управления рисками, предполагающие исключение рискованных ситуаций из бизнеса, носят название

- а) методы диссипации риска;
- б) методы компенсации риска;
- в) методы уклонения от риска;

г) методы локализации риска.

10. Методы управления рисками, основанные на четкой идентификации источников риска, носят название

- а) методы диссипации риска;
- б) методы компенсации риска;
- в) методы уклонения от риска;
- г) методы локализации риска.

### **Зачетно-экзаменационные материалы для промежуточной аттестации (экзамен)**

Тема 1. Предпосылки возникновения риска. Неопределенность и угрозы.

- 1. Охарактеризуйте основные источники опасности.
- 2. Что такое неопределенность. Какие виды неопределенности существуют?
- 3. Угрозы и опасности, их связь с неопределенностью и различие.
- 4. По каким признакам можно классифицировать опасности и угрозы?

Тема 2. Сущность, объекты, субъекты и функции риска.

- 5. Исторический аспект развития риска.
- 6. Назовите основные характеристики риска.
- 7. В чем отличие и схожесть риска и шанса?
- 8. В чем заключаются объективные и субъективные свойства риска?
- 9. Назовите функции риска

Тема 3. Классификация рисков.

- 10. Почему нужна система классификации рисков? Каковы основные подходы к классификации рисков?
- 11. Какие основные группы рисков можно выделить по сфере их возникновения?
- 12. В чем состоит сложность деления рисков на внешние и внутренние?
- 13. Как можно классифицировать риски по временным показателям (по продолжительности действия и изменению уровня риска во времени)?
- 14. Чем различаются чистые и спекулятивные риски?
- 15. Что такое экономический риск?
- 16. Какие существуют системы классификации убытков?
- 17. Как связаны между собой системы классификации рисков и отраслей (видов) страхования?
- 18. Какие подходы применяются при классификации бизнес-рисков?

Тема 4. Управление рисками проекта.

- 19. Как менялись подходы к управлению рисками?
- 20. Основные функции риск-менеджмента.
- 21. Какие стадии можно выделить в функционировании системы рискменеджмента?
- 22. Назовите основные правила риск-менеджмента.
- 23. Какие основные группы ограничений существуют для системы управления рисками?
- 24. Какие конфликты целей (требований) возможны при построении системы управления рисками?

Тема 5. Анализ и оценка рисков.



25. Назовите основные задачи и принципы стандартизации.
26. Какие методы используются для анализа рисков?
27. Как рассчитать риск?
28. Какой риск считается приемлемым? Как это определить?

Тема 6. Методы управления рисками.

29. Охарактеризуйте основные методы управления рисками.
30. Что такое диверсификация?
31. При каком методе управления рисками создаются кэптивные компании?
32. Особенности применения страхования и хеджирования.
33. Перечислите методы воздействия на внутренние риски.

Тема 7. Принятие решений в условиях определенности, риска и неопределенности.

34. Что такое решение, какие виды решений существуют?
35. Особенности принятия решений в управлении.
36. Какие модели принятия решений применяются в науке управления?
37. Охарактеризуйте простые методы принятия решений.
38. Охарактеризуйте вероятностные методы принятия решений.

### **Критерии оценивания результатов обучения**

#### **Критерии оценивания результатов обучения**

Оценка	Критерии оценивания по экзамену
Высокий уровень «5» (отлично)	оценку «отлично» заслуживает студент, освоивший знания, умения, компетенции и теоретический материал без пробелов; выполнивший все задания, предусмотренные учебным планом на высоком качественном уровне; практические навыки профессионального применения освоенных знаний сформированы.
Средний уровень «4» (хорошо)	оценку «хорошо» заслуживает студент, практически полностью освоивший знания, умения, компетенции и теоретический материал, учебные задания не оценены максимальным числом баллов, в основном сформировал практические навыки.
Пороговый уровень «3» (удовлетворительно)	оценку «удовлетворительно» заслуживает студент, частично с пробелами освоивший знания, умения, компетенции и теоретический материал, многие учебные задания либо не выполнил, либо они оценены числом баллов близким к минимальному, некоторые практические навыки не сформированы.
Минимальный уровень «2» (неудовлетворительно)	оценку «неудовлетворительно» заслуживает студент, не освоивший знания, умения, компетенции и теоретический материал, учебные задания не выполнил, практические навыки не сформированы.

Оценочные средства для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья выбираются с учетом их индивидуальных психофизических особенностей.

– при необходимости инвалидам и лицам с ограниченными возможностями здоровья предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на экзамене;

– при проведении процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья предусматривается использование технических средств, необходимых им в связи с их индивидуальными особенностями;

– при необходимости для обучающихся с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения по дисциплине может проводиться в несколько этапов.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по дисциплине (модулю) предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

- в печатной форме увеличенным шрифтом,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями слуха:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме,
- в форме электронного документа.

Данный перечень может быть конкретизирован в зависимости от контингента обучающихся.

## **5. Перечень учебной литературы, информационных ресурсов и технологий**

### **5.1. Учебная литература**

1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент: учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юрайт, 2022. - 365 с. - URL: <https://urait.ru/bcode/489098> (дата обращения: 23.03.2022). - Режим доступа: для авториз. пользователей. - ISBN 978-5-9916-3502-8. <https://urait.ru/bcode/489098>

2. Ковалев, П. П. Банковский риск-менеджмент: учебное пособие / П. П. Ковалев. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: КУРС: ИНФРА-М, 2019. - 320 с. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1024006> (дата обращения: 01.12.2020). - Режим доступа: для авториз. пользователей. - ISBN 978-5-905554-36-0. <https://znanium.com/catalog/product/1024006>

3. Воронцовский, А. В. Управление рисками [Электронный ресурс]: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. - М.: Юрайт, 2018. - 414 с. - <https://biblio-online.ru/book/E098C311-CAA9-4FD5-AC72-5F801419DD64>.

4. Авдийский, Владимир Иванович. Теория и практика управления рисками организации: учебник для студентов вузов, / В. И. Авдийский, В. М. Безденежных. - Москва: КНОРУС, 2018. - 275 с.

### **5.2. Периодическая литература**

Научной библиотеки КубГУ» <https://www.kubsu.ru/ru/node/15554>:

1. Экономика и управление
2. Управление риском
3. Искусственный интеллект и принятие решений
4. Управление финансовыми рисками
1. Базы данных компании «Ист Вью» <http://dlib.eastview.com>
2. Электронная библиотека GREBENNIKON.RU <https://grebennikon.ru/>

### **5.3. Интернет-ресурсы, в том числе современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы**

Электронно-библиотечные системы (ЭБС):

1. ЭБС «ЮРАЙТ» <https://urait.ru/>
2. ЭБС «УНИВЕРСИТЕТСКАЯ БИБЛИОТЕКА ОНЛАЙН» [www.biblioclub.ru](http://www.biblioclub.ru)
3. ЭБС «BOOK.ru» <https://www.book.ru>
4. ЭБС «ZNANIUM.COM» [www.znanium.com](http://www.znanium.com)

5. ЭБС «ЛАНЬ» <https://e.lanbook.com>

**Профессиональные базы данных:**

1. Scopus <http://www.scopus.com/>
2. ScienceDirect [www.sciencedirect.com](http://www.sciencedirect.com)
3. Журналы издательства Wiley <https://onlinelibrary.wiley.com/>
4. Научная электронная библиотека (НЭБ) <http://www.elibrary.ru/>
5. Полнотекстовые архивы ведущих западных научных журналов на Российской платформе научных журналов НЭИКОН <http://archive.neicon.ru>
6. Национальная электронная библиотека (доступ к Электронной библиотеке диссертаций Российской государственной библиотеки (РГБ) <https://rusneb.ru/>
7. Президентская библиотека им. Б.Н. Ельцина <https://www.prilib.ru/>
8. Электронная коллекция Оксфордского Российского Фонда <https://ebookcentral.proquest.com/lib/kubanstate/home.action>
9. Springer Journals <https://link.springer.com/>
10. Nature Journals <https://www.nature.com/siteindex/index.html>
11. Springer Nature Protocols and Methods <https://experiments.springernature.com/sources/springer-protocols>
12. Springer Materials <http://materials.springer.com/>
13. zbMath <https://zbmath.org/>
14. Nano Database <https://nano.nature.com/>
15. Springer eBooks: <https://link.springer.com/>
16. "Лекториум ТВ" <http://www.lektorium.tv/>
17. Университетская информационная система РОССИЯ <http://uisrussia.msu.ru>

**Информационные справочные системы:**

1. Консультант Плюс - справочная правовая система (доступ по локальной сети с компьютеров библиотеки)

**Ресурсы свободного доступа:**

1. Американская патентная база данных <http://www.uspto.gov/patft/>
2. КиберЛенинка (<http://cyberleninka.ru/>);
3. Министерство науки и высшего образования Российской Федерации <https://www.minobrnauki.gov.ru/>;
4. Федеральный портал "Российское образование" <http://www.edu.ru/>;
5. Информационная система "Единое окно доступа к образовательным ресурсам" <http://window.edu.ru/>;
6. Единая коллекция цифровых образовательных ресурсов <http://school-collection.edu.ru/> .
7. Проект Государственного института русского языка имени А.С. Пушкина "Образование на русском" <https://pushkininstitute.ru/>;
8. Справочно-информационный портал "Русский язык" <http://gramota.ru/>;
9. Служба тематических толковых словарей <http://www.glossary.ru/>;
10. Словари и энциклопедии <http://dic.academic.ru/>;
11. Образовательный портал "Учеба" <http://www.ucheba.com/>;
12. Законопроект "Об образовании в Российской Федерации". Вопросы и ответы [http://xn--273--84dlf.xn--plai/voprosy\\_i\\_otvety](http://xn--273--84dlf.xn--plai/voprosy_i_otvety)

**Собственные электронные образовательные и информационные ресурсы КубГУ:**

1. Электронный каталог Научной библиотеки КубГУ <http://megapro.kubsu.ru/MegaPro/Web>

2. Электронная библиотека трудов ученых КубГУ  
<http://megapro.kubsu.ru/MegaPro/UserEntry?Action=ToDb&idb=6>
3. Среда модульного динамического обучения <http://moodle.kubsu.ru>
4. База учебных планов, учебно-методических комплексов, публикаций и конференций <http://mschool.kubsu.ru/>
5. Библиотека информационных ресурсов кафедры информационных образовательных технологий <http://mschool.kubsu.ru;>
6. Электронный архив документов КубГУ <http://docspace.kubsu.ru/>
7. Электронные образовательные ресурсы кафедры информационных систем и технологий в образовании КубГУ и научно-методического журнала "ШКОЛЬНЫЕ ГОДЫ" <http://icdau.kubsu.ru/>

## **6. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)**

Самостоятельная работа слушателей по дисциплине «Риск-менеджмент в проектной деятельности» проводится с целью закрепления и систематизации теоретических знаний, формирования практических навыков по их применению при решении экономических задач в выбранной

предметной области. Самостоятельная работа включает: изучение основной и дополнительной литературы, проработка и повторение лекционного материала, материала учебной и научной литературы, подготовку к практическим занятиям, подготовка рефератов (презентаций), подготовка к тестированию и эссе.

Для подготовки к лекциям необходимо изучить основную и дополнительную литературу, при изучении которой студент может в достаточном объеме усвоить и успешно реализовать конкретные знания, умения, навыки и компетенции при выполнении следующих условий:

- систематическая работа на аудиторных занятиях под руководством преподавателя и самостоятельная работа по закреплению полученных знаний и навыков;
- выполнение заданий преподавателя на практических занятиях;
- выяснение и уточнение отдельных предпосылок, умозаключений и выводов, содержащихся в учебном курсе;
- осознание взаимосвязей отдельных разделов дисциплины, используемых методов, характера их использования в практической деятельности менеджера.

В ходе самостоятельной подготовки к практическим занятиям студент осуществляет сбор и обработку материалов по соответствующей тематике, используя при этом открытые источники информации (публикации в научных изданиях, аналитические материалы, ресурсы сети Интернет и пр.), а также практический опыт и доступные материалы объекта исследования. Контроль за выполнением самостоятельной работы проводится при изучении каждой темы дисциплины на практических (семинарских) занятиях.

Подготовка реферата (доклада-презентации) – закрепление теоретических основ и проверка знаний студентов по вопросам основ и практической организации научных исследований, умение подбирать, анализировать и обобщать материалы, раскрывающие связи между теорией и практикой. Подготовка презентации предполагает творческую активность обучающегося, умение работать с литературой, владение методами анализа данных и компьютерными технологиями их реализации.

В освоении дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья большое значение имеет индивидуальная учебная работа (консультации) – дополнительное разъяснение учебного материала.

Индивидуальные консультации по предмету являются важным фактором, способствующим индивидуализации обучения и установлению воспитательного контакта между преподавателем и обучающимся инвалидом или лицом с ограниченными возможностями здоровья.

## 7. Материально-техническое обеспечение по дисциплине (модулю)

Наименование специальных помещений	Оснащенность специальных помещений	Перечень лицензионного программного обеспечения
Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Мебель: учебная мебель Технические средства обучения: экран, проектор, ноутбук	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus
Учебные аудитории для проведения занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации	Мебель: учебная мебель Технические средства обучения: экран, проектор, ноутбук	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus
Помещение для самостоятельной работы обучающихся (ауд.213 А, 218 А)	Мебель: учебная мебель Комплект специализированной мебели: компьютерные столы Оборудование: компьютерная техника с подключением к информационно-коммуникационной сети «Интернет» и доступом в электронную информационно-образовательную среду образовательной организации, веб-камеры, коммуникационное оборудование, обеспечивающее доступ к сети интернет (проводное соединение и беспроводное соединение по технологии Wi-Fi)	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus

Для самостоятельной работы обучающихся предусмотрены помещения, укомплектованные специализированной мебелью, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета.

Наименование помещений для самостоятельной работы обучающихся	Оснащенность помещений для самостоятельной работы обучающихся	Перечень лицензионного программного обеспечения
Помещение для самостоятельной работы обучающихся (читальный зал Научной библиотеки)	Мебель: учебная мебель Комплект специализированной мебели: компьютерные столы Оборудование: компьютерная техника с подключением к информационно-коммуникационной сети «Интернет» и доступом в электронную информационно-образовательную среду образовательной организации, веб-камеры, коммуникационное оборудование, обеспечивающее доступ к сети интернет (проводное соединение и беспроводное соединение по технологии Wi-Fi)	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus
Помещение для самостоятельной работы обучающихся (ауд.213 А, 218 А)	Мебель: учебная мебель Комплект специализированной мебели: компьютерные столы Оборудование: компьютерная техника с подключением к информационно-	Microsoft Windows 8, 10, Microsoft Office Professional Plus

	коммуникационной сети «Интернет» и доступом в электронную информационно-образовательную среду образовательной организации, веб-камеры, коммуникационное оборудование, обеспечивающее доступ к сети интернет (проводное соединение и беспроводное соединение по технологии Wi-Fi)	
--	--	--