

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Смирнов Сергей Николаевич  
Должность: врио ректора  
Дата подписания: 19.10.2023 08:08:36  
Уникальный программный ключ:  
69e375c64f7e975d4e8830e7b4fcc2ad1bf35f08

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
ФГБОУ ВО «Тверской государственный университет»



Утверждаю:  
Руководитель ООП  
И.А. Каплунов  
«30» мая 2023 г.

Рабочая программа дисциплины (с аннотацией)  
**Основы управления проектными рисками**

Направление подготовки

03.04.03. Радиоп физика

профиль

Физика и технология материалов и устройств радиоэлектроники

Для студентов

1 курса очной формы обучения

Составитель: к.э.н., доцент Толкаченко О.Ю.

Тверь, 2023

## **I. Аннотация**

### **1. Цель и задачи дисциплины**

Целью учебной дисциплины является сформировать у студентов теоретические знания и практические навыки разработки, принятия и реализации решений по управлению проектными рисками.

Задачами курса в области управления проектными рисками являются:

- усвоение сведений о сущности управления рисками;
- изучение понятия и методологии разработки проектов;
- усвоение информации об особенностях управления проектными рисками;
- изучение необходимости управления проектными рисками в условиях рыночной экономики.

### **2. Место дисциплины в структуре ООП**

Дисциплина «Основы управления проектными рисками» относится к модулю Элективные дисциплины 1 части учебного плана ООП, формируемой участниками образовательных отношений.

Для успешного освоения дисциплины магистрант должен знать основные методы снижения проектных рисков; владеть алгоритмом управления проектными рисками.

Принципы и установки управления проектными рисками лежат в основе профессионального менеджмента. Базовые знания, которыми должен обладать слушатель после изучения дисциплины «Основы управления проектными рисками» призваны способствовать освоению дисциплин, направленных на формирование профессиональных знаний и умений, а также накоплению профессиональных навыков в период прохождения практик.

**3. Объем дисциплины:** 2 зачетные единицы, 72 академических часа, **в том числе:**

**контактная аудиторная работа:** лекции 15 часов;

**самостоятельная работа:** 57 часов.

#### 4. Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Планируемые результаты освоения образовательной программы (формируемые компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
УК-1 Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий.	УК-1.2. Определяет пробелы в информации, необходимой для решения проблемной ситуации, и проектирует процессы по их устранению УК-1.3. Критически оценивает надежность источников информации, работает с противоречивой информацией из разных источников
УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла.	УК-2.1. Формулирует на основе поставленной проблемы проектную задачу и способ ее решения через реализацию проектного управления; УК-2.2. Разрабатывает концепцию проекта в рамках обозначенной проблемы: формулирует цель, задачи, обосновывает актуальность, значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы их применения; УК-2.3. Разрабатывает план реализации проекта с учетом возможных рисков реализации и возможностей их устранения, планирует необходимые ресурсы, в том числе с учетом их заменяемости; УК-2.4. Осуществляет мониторинг хода реализации проекта, корректирует отклонения, вносит дополнительные изменения в план реализации проекта, уточняет зоны ответственности участников проекта; УК-2.5. Предлагает процедуры и механизмы оценки качества проекта, инфраструктурные условия для внедрения результатов проекта.
УК-4. Способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия.	УК-4.3. Составляет типовую деловую документацию для академических и профессиональных целей на иностранном языке.
УК-5. Способен анализировать и учитывать разнообразие культур в процессе межкультурного взаимодействия.	УК-5.2. Выстраивает социальное и профессиональное взаимодействие с учетом особенностей деловой и общей культуры представителей других этносов и конфессий, различных социальных групп.
ПК-1. Способен организовать выполнение научно-исследовательских работ по разработке материалов и устройств радиоэлектроники.	ПК-1.1. Разрабатывает проекты планов научного исследования; ПК-1.2. Осуществляет работу по ресурсному обеспечению научно-исследовательских работ;

	ПК-1.3. Контролирует качество выполнения и соответствие плану проводимых научно-исследовательских работ.
--	--

**5. Форма промежуточной аттестации и семестр прохождения**

Зачет во 2 семестре

**6. Язык преподавания:** русский.

**II. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий.**

**1. Для студентов очной формы обучения**

Учебная программа – наименование разделов и тем	Всего (час.)	Контактная работа (час.)		Самостоятельная работа, в том числе Контроль (час.)
		Лекции		
		всего	в т.ч. ПП	
Сущность управления рисками	15	3		12
Понятие и методология разработки проектов	18	3		15
Особенности управления проектными рисками	18	3		15
Необходимость управления проектными рисками в условиях рыночной экономики	19	4		15
<b>Зачет</b>	2	2		
<b>Итого</b>	72	15		57

**III. Образовательные технологии**

Учебная программа-наименование разделов и тем	Вид занятия	Образовательные технологии
Сущность управления рисками	<i>Лекции</i>	1.Изложение теоретического материала (презентация) 2.Решение задач 3.Самостоятельное изучение теоретического материала
Понятие и методология разработки проектов	<i>Лекции</i>	1.Изложение теоретического материала (презентация) 2.Решение задач 3.Самостоятельное изучение теоретического материала
Особенности управления проектными рисками	<i>Лекции</i>	1.Изложение теоретического материала (презентация) 2.Решение задач 3.Самостоятельное изучение теоретического материала
Необходимость управления проектными рисками в условиях рыночной экономики	<i>Лекции</i>	1.Изложение теоретического материала (презентация) 2.Решение задач 3.Самостоятельное изучение теоретического материала

#### **IV. Оценочные материалы для проведения текущей и промежуточной аттестации**

*Форма проведения промежуточного контроля:* студенты, освоившие программу курса «Основы управления проектными рисками» могут получить зачет по итогам семестровой аттестации согласно «Положению о промежуточной аттестации (экзаменах и зачетах) обучающихся по программам высшего образования ТвГУ» (протокол №11 от 28 апреля 2021 г.).

**Для проведения текущей и промежуточной аттестации:**

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

УК-1.2. Определяет пробелы в информации, необходимой для решения проблемной ситуации, и проектирует процессы по их устранению

УК-1.3. Критически оценивает надежность источников информации, работает с противоречивой информацией из разных источников

**Форма аттестации:**

Решение задач

Задача 1: Имеются два инвестиционных проекта: ИП1 и ИП2 с одинаковой прогнозной суммой требуемых капитальных вложений. Величина планируемого дохода (тыс. руб.) неопределенна и приведена в виде распределения вероятностей (табл.). Оценить рискованность каждого проекта, используя критерий отбора – «максимизация математического ожидания дохода». Характеристика проектов по доходам и вероятностям его получения:

Инвестиционный проект ИП1

Доход, тыс. руб.	Вероятность (В)
2500	0,15
3000	0,20
3500	0,35
5000	0,20

6000	0,10
------	------

Инвестиционный проект ИП2

Доход, тыс. руб.	Вероятность (В)
1500	0,10
2500	0,15
4000	0,30
5000	0,30
7000	0,15

**Способ аттестации:** письменный

**Критерии оценки:**

Имеется полное решение, включающее правильный ответ – 3 балла

решение недостаточно обосновано – 2 балла

дано неверное решение – 0 баллов

**УК-2. Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла:**

УК-2.1. Формулирует на основе поставленной проблемы проектную задачу и способ ее решения через реализацию проектного управления;

УК-2.2. Разрабатывает концепцию проекта в рамках обозначенной проблемы: формулирует цель, задачи, обосновывает актуальность, значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы их применения;

УК-2.3. Разрабатывает план реализации проекта с учетом возможных рисков реализации и возможностей их устранения, планирует необходимые ресурсы, в том числе с учетом их заменяемости;

УК-2.4. Осуществляет мониторинг хода реализации проекта, корректирует отклонения, вносит дополнительные изменения в план реализации проекта, уточняет зоны ответственности участников проекта;

УК-2.5. Предлагает процедуры и механизмы оценки качества проекта, инфраструктурные условия для внедрения результатов проекта.

**Форма аттестации:**

**Способ аттестации:**

## **Критерии оценки:**

**УК-4. Способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия:**

УК-4.3. Составляет типовую деловую документацию для академических и профессиональных целей на иностранном языке.

### **Форма аттестации:**

#### Написание реферата

1. Основные методы оценки уровня рисков.
2. Задачи качественной оценки рисков.
3. Сущность и задачи количественной оценки рисков.
4. Положительные и отрицательные стороны конкретных методов оценки рисков.
5. Метод оценки хозяйственных рисков по аналогии.
6. Особенности статистического метода диагностики рисков.
7. Основные средства измерения риска.
8. Дисперсия и среднеквадратичное отклонение как простейшие количественные показатели риска.
9. Работа с реальными данными: измерение доходности, выборочные оценки.
10. Оценка горизонта прогноза.
11. Понятие «стоимости под риском» (Value At Risk, VAR).
12. Показатель VAR как основная мера риска. Три основных метода вычисления VAR: аналитический (иначе называемый методом вариации-ковариации), историческое моделирование и статистическое моделирование (метод Монте-Карло). Понятие VAR для портфеля.
13. Особенности метода экспертных оценок.

### **Способ аттестации: письменный**

### **Критерии оценки:**

- Оригинальность текста составляет свыше 75% - 3 балла
- Оригинальность текста составляет 50-74 % - 2 балла



- Оригинальность текста составляет 25-49 % - 1 балл
  - Оригинальность текста составляет менее 25% - 0 баллов
  - привлечены ли наиболее известные работы по теме исследования (в т.ч. публикации последних лет) – 2 балла
  - реферат опирается на учебную литературу и/ или устаревшие издания – 1 балл
14. Отражение в плане ключевых аспектов темы – 2 балла;
15. Фрагментарное отражение ключевых аспектов темы – 1 балл;
16. Полное соответствие содержания теме и плану реферата – 2 балла;
17. Частичное соответствие содержания теме и плану реферата – 1 балла;
18. сопоставление различных точек зрения по одному вопросу (проблеме) – 1 балла;
19. Все представленные выводы обоснованы – 2 балла;
20. Аргументирована часть выводов – 1 балл.
- верно оформлены ссылки на используемую литературу – 1 балл
  - соблюдены правила орфографической, пунктуационной, стилистической культуры – 1 балл;
- соблюдены требования к объёму реферата – 1 балл.

**УК-5. Способен анализировать и учитывать разнообразие культур в процессе межкультурного взаимодействия:**

УК-5.2. Выстраивает социальное и профессиональное взаимодействие с учетом особенностей деловой и общей культуры представителей других этносов и конфессий, различных социальных групп.

**Форма аттестации:**

Устный ответ

Тема 1. Сущность управления рисками. Понятие риска. Классификация рисков. Факторы, влияющие на уровень риска. Методы нейтрализации рисков.

**Способ аттестации:** устный

**Критерии оценки:**

- Тема раскрыта с опорой на соответствующие понятия и теоретические положения – 2 балла
- Аргументация на теоретическом уровне неполная, смысл ряда ключевых понятий не объяснен – 1 балл
- Терминологический аппарат непосредственно не связан с раскрываемой темой – 0 баллов
- Факты и примеры в полном объеме обосновывают выводы – 2 балла
- Допущена фактическая ошибка, не приведшая к существенному искажению смысла – 1 балл
- Допущены фактические и логические ошибки, свидетельствующие о непонимании темы – 0 баллов
- Ответ характеризуется композиционной цельностью, соблюдена логическая последовательность, поддерживается равномерный темп на протяжении всего ответа – 2 балла
- Ответ характеризуется композиционной цельностью, есть нарушения последовательности, большое количество неоправданных пауз – 1 балл
- Не прослеживается логика, мысль не развивается – 0 баллов

**ПК-1. Способен организовать выполнение научно-исследовательских работ по разработке материалов и устройств радиоэлектроники:**

ПК-1.1. Разрабатывает проекты планов научного исследования;

ПК-1.2. Осуществляет работу по ресурсному обеспечению научно-исследовательских работ;

ПК-1.3. Контролирует качество выполнения и соответствие плану проводимых научно-исследовательских работ.

**Форма аттестации:**

**тест**

- Верно ли утверждение, что на стадии разработки проекта расходуется более 50% ресурсов проекта?
- Финансово-экономическое обоснование расходов в ходе реализации научного проекта формирует это?

## Способ аттестации: письменный

### Критерии оценки:

За верный ответ – 1 балл

#### V. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

##### 1) Рекомендуемая литература

###### а) основная литература:

1. Родионова, Н.В. Методы исследования в менеджменте : учебник / Н.В. Родионова. - М. : Юнити-Дана, 2015. - Модуль 1. Организация исследовательской деятельности. - 415 с. - Библиогр: с. 333. - ISBN 978-5-238-02275-8 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=119007>
2. [Гармаш А. Н.](#) Математические методы в управлении: Учебное пособие / А.Н. Гармаш, И.В. Орлова. - М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2012. - 272 с. - Электронный учебник: - Режим доступа: <http://znanium.com/go.php?id=242620>

###### б) дополнительная литература

1. Инвестиционный менеджмент: учебник / П.Н. Брусов, Т.В. Филатова, Н.И. Лахметкина. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 333 с.: 60x90 1/16. - (Высшее образование: Бакалавриат). (переплет) ISBN 978-5-16-005020-1 <http://znanium.com/go.php?id=363435>

##### 2) Программное обеспечение

###### а) Лицензионное программное обеспечение

###### б) Свободно распространяемое программное обеспечение

##### 3) Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1.ЭБС«ZNANIUM.COM» [www.znanium.com](http://www.znanium.com);

2.ЭБС «Университетская библиотека онлайн»<https://biblioclub.ru/>;

3. ЭБС «Лань» <http://e.lanbook.com>

4) Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

1. <http://chelpro.ru/get-professional/primer-kodeksa>

2. [http://www.akdi.ru/pravo/news/proekt\\_kpgs.htm](http://www.akdi.ru/pravo/news/proekt_kpgs.htm)

3. <http://www.geshtalpsy.ru/interesno1.php>

4. <http://www.hr-portal.ru/node/36201>;

5. <http://www.biznesprocess.ru/2009/08/metod-nominalnyx-grupp/>

## **VI. Методические материалы для обучающихся по освоению дисциплины**

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

### **Методические рекомендации по организации самостоятельной работы**

Государственным образовательным стандартом высшего обучения предусматривается выделение в учебных планах ВУЗов времени, отводимого на самостоятельную (внеаудиторную) работу студентов. Главное в её правильной организации – планирование, задаваемое тематическими планами и последовательностью изучения экономических дисциплин. Известно, что в процессе обучения в ВУЗе удельный вес самостоятельной работы достаточно велик. Поэтому для студента крайне важно овладеть её правильной методикой.

Краткие рекомендации по тем видам самостоятельной работы, которые могут быть использованы при изучении данного курса. К таким видам относятся:

⇒ работа над лекционным материалом;

⇒ работа над учебными пособиями, монографиями, научной периодикой;

⇒ изучение и конспектирование нормативного материала;

⇒ написание рефератов;

⇒ подготовка к экзамену.

Рассмотрим некоторые из них подробнее. Самостоятельная работа начинается до прихода студента на лекцию. Целесообразно использование «системы опережающего чтения», т.е. предварительного прочитывания лекционного материала, содержащегося в учебниках и учебных пособиях, закладывающего базу для более глубокого восприятия лекции. Работа над лекционным материалом включает два основных этапа: конспектирование лекций и последующую работу над лекционным материалом. Под конспектированием подразумевают составление конспекта, т.е. краткого письменного изложения содержания чего-либо (устного выступления – речи, лекции, доклада и т.п. или письменного источника – документа, статьи, книги и т.п.).

Методика работы при конспектировании устных выступлений значительно отличается от методики работы при конспектировании письменных источников. Конспектируя письменные источники, студент имеет возможность неоднократно прочитать нужный отрывок текста, поразмыслить над ним, выделить основные мысли автора, кратко сформулировать их, а затем записать. При необходимости он может отметить и свое отношение к этой точке зрения. Слушая же лекцию, студент большую часть комплекса указанных выше работ должен откладывать на другое время, стремясь использовать каждую минуту на запись лекции, а не на ее осмысление – для этого уже не остается времени. Поэтому при конспектировании лекции рекомендуется на каждой странице отделять поля для последующих записей в дополнение к конспекту.

Записав лекцию или составив ее конспект, не следует оставлять работу над лекционным материалом до начала подготовки к зачету. Нужно проделать как можно раньше ту работу, которая сопровождает конспектирование письменных источников и которую не удалось сделать во время записи лекции: прочесть свои записи, расшифровав отдельные сокращения, проанализировать текст, установить логические связи между его элементами, в ряде случаев показать их графически, выделить главные мысли, отметить вопросы, требующие дополнительной обработки, в частности, консультации преподавателя. При работе над текстом лекции студенту необходимо обратить особое внимание на проблемные вопросы,

поставленные преподавателем при чтении лекции, а также на его задания и рекомендации. Работая над текстом лекции, необходимо иметь под рукой справочные издания: словарь-справочник, энциклопедический экономический словарь, в которых можно найти объяснение многим встречающимся в тексте терминам, содержание которых студент представляет себе весьма туманно, хотя они ему и знакомы.

Свою специфику имеет работа с учебными пособиями, монографиями, периодикой. Перечень вопросов, подлежащих изучению, приведен в учебно-методическом комплексе по данной дисциплине. Не все эти вопросы будут достаточно полно раскрыты на лекциях. Отдельные вопросы будут освещены недостаточно полно или вообще не будут затронуты. Поэтому, проработав лекцию по конспекту, необходимо сравнить перечень поднятых в ней вопросов с тем перечнем, который приведен в указанном источнике по данной теме, и изучить ряд вопросов по учебным пособиям, дополняя при этом конспект лекций. Как видно из примерного тематического плана курса, на сессии будут прочитаны лекции не по всем вопросам курса. Часть тем будет вынесена на самостоятельное изучение студентами, прежде всего с помощью учебных пособий. Следует хорошо помнить, что работа с учебными пособиями не имеет ничего общего со сквозным пограничным чтением текста. Она должна быть направлена на поиски ответов на конкретно поставленные в программе вопросы или вопросы для подготовки к зачету. Работая с учебными пособиями, не следует забывать о справочных изданиях.

Все, сказанное выше, в равной степени относится и к работе в монографической литературе и научной периодикой. При работе над темами, которые вынесены на самостоятельное изучение, студент должен самостоятельно выделить наиболее важные, узловые проблемы, как это в других темах делалось преподавателем. Здесь не следует с целью экономии времени подходить к работе поверхностно, ибо в таком случае повышается опасность "утонуть" в обилии материала, упустить центральные проблемы. Результатом самостоятельной

работы должно стать собственное самостоятельное представление студента об изученных вопросах.

Работа с периодикой и монографиями также не должна состоять из сквозного чтения или просмотра текста. Она должна включать вначале ознакомительное чтение, а затем поиск ответов на конкретные вопросы. Основная трудность для студентов заключается здесь в необходимости-усвоения, понимания и запоминания значительных объемов материала. Эту трудность, связанную, прежде всего, с дефицитом времени, можно преодолеть путем усвоения интегрального алгоритма чтения.

Подготовка к семинарскому занятию требует прежде всего чтения рекомендуемых нормативных и монографических работ, их реферирования, подготовки докладов и сообщений. Особенно это актуально при использовании новых форм обучения: семинаров-конференций, коллоквиумов, деловых игр и т.п. В последнее время все большее распространение получают просмотры видеокассет с записью лекций преподавателя, использование иной аудиовизуальной техники.

В процессе организации самостоятельной работы большое значение имеют консультации с преподавателем, в ходе которых можно решить многие проблемы изучаемого курса, уяснить сложные вопросы. Последние не следует оставлять «на потом», так как на экзамене действует, как правило, «закон подлости»: в билетах попадается именно тот вопрос, который хуже всего знаешь. Беседа студента и преподавателя может дать многое - это простой прием получения знаний. Самостоятельная работа носит сугубо индивидуальный характер, однако вполне возможно и коллективное осмысление проблем экономической науки.

### **Методические рекомендации по написанию реферата**

Реферат (от латинского "докладывать", "сообщать") представляет собой доклад на определенную тему, включающий обзор соответствующих литературных и других источников или краткое изложение книги, статьи, исследования, а также доклад с таким изложением.

Таким образом, реферат — это сокращенный пересказ содержания первичного документа (или его части) с основными фактическими сведениями и выводами.

Написание реферата практикуется в учебном процессе вуза в целях приобретения студентом необходимой профессиональной подготовки, развития умения и навыков самостоятельного научного поиска: изучения литературы по выбранной теме, анализа различных источников и точек зрения, обобщения материала, выделения главного, формулирования выводов и т. п. С помощью рефератов студент глубже постигает наиболее сложные проблемы курса, учится лаконично излагать свои мысли, правильно оформлять работу, докладывать результаты своего труда. Подготовка рефератов способствует формированию правовой культуры у будущего специалиста, закреплению у него юридических знаний, развитию умения самостоятельно анализировать многообразные общественно-политические явления современности, вести полемику.

Процесс написания реферата включает:

- выбор темы;
- подбор нормативных актов, специальной литературы и иных источников, их изучение;
- составление плана;
- написание текста работы и ее оформление;
- устное изложение реферата.

Рефераты пишутся по наиболее актуальным темам. В них на основе тщательного анализа и обобщения научного материала сопоставляются различные взгляды авторов, и определяется собственная позиция студента с изложением соответствующих аргументов.

Темы рефератов должны охватывать и дискуссионные вопросы курса. Они призваны отражать передовые научные идеи, обобщать тенденции юридической практики, учитывая при этом изменения в текущем законодательстве. Студент при желании может сам предложить ту или иную тему, предварительно согласовав ее с научным руководителем.



Работу над рефератом следует начинать с общего ознакомления с темой (прочтение соответствующего раздела учебника, учебного пособия, конспектов лекций). После этого необходимо изучить нормативные акты, литературные и иные источники, рекомендованные преподавателем. Однако перечень источников не должен связывать инициативу студента. Он может использовать произведения, самостоятельно подобранные в результате изучения библиографии в библиотеке. Особенно внимательно необходимо следить за новой литературой по избранной проблематике, в том числе за журнальными статьями. В процессе изучения литературы рекомендуется делать выписки, постепенно группируя и накапливая теоретический и практический материал. План реферата должен быть составлен таким образом, чтобы он раскрывал название работы.

Реферат, как правило, состоит из введения, в котором кратко обосновывается актуальность, научная и практическая значимость избранной темы, основного материала, содержащего суть проблемы и пути ее решения, и заключения, где формируются выводы, оценки, предложения.

Изложение материала должно быть кратким, точным, последовательным. Необходимо употреблять термины, свойственные науке конституционного права, избегать непривычных или двусмысленных понятий и категорий, сложных грамматических оборотов. Термины, отдельные слова и словосочетания допускается заменять принятыми текстовыми сокращениями, смысл которых ясен из контекста. Рекомендуется включать в реферат схемы и таблицы, если они помогают раскрыть основное содержание проблемы и сокращают объем работы.

Работа может быть представлена к защите в рукописном или печатном виде. Ее объем должен составлять 10-15 страниц Roman, размер 14, интервал 1,5, поля 2,5 см со всех сторон.

На титульном листе студент указывает название института, полное наименование темы реферата, свою фамилию и инициалы, а также ученую степень, звание, фамилию и инициалы научного руководителя, а в самом конце — дату написания работы и личную подпись.

Особое внимание следует уделить оформлению научно-справочного аппарата и прежде всего подстрочных сносок (внизу страницы, под чертой). Сноска должна быть полной: с указанием фамилии и инициалов автора, названия книги, места и года ее издания, страницы, с которой взята цитата или соответствующее положение. Для статей из журналов, сборников указывают фамилию и инициалы автора, название статьи, затем название журнала или сборника статей с указанием года издания и номера (или выпуска). При ссылке на газетную статью кроме названия и года издания указывают дату. Оформляя нормативные источники, необходимо указывать полное и точное название нормативного акта, дату его принятия и редакции, а также изменений и дополнений. При этом обязательными являются название, год, номер и статья официального издания, где был опубликован нормативный акт. Текст полностью написанной и оформленной работы подлежит тщательной проверке. Ошибки и опiski как в тексте, так и в цитатах и в научно-справочном аппарате отрицательно сказываются на оценке.

Содержание реферата студент докладывает на семинаре, кружке, научной конференции. Предварительно подготовив тезисы доклада, студент в течение 7—10 минут должен кратко изложить основные положения своей работы. После доклада автор отвечает на вопросы, затем выступают оппоненты, которые заранее познакомились с текстом реферата, и отмечают его сильные и слабые стороны. На основе обсуждения студенту выставляется соответствующая оценка.

#### **ТЕМЫ РЕФЕРАТОВ:**

1. Необходимость оценки рисков.
2. Этапы идентификации рисков.
3. Информационное обеспечение процесса идентификации. Понятие величины (степени) риска.
4. Предпринимательские потери и зоны риска.

5. Система показателей оценки риска (абсолютные, относительные, средние, вероятностные, статистические, экспертные – сущность, виды, методы расчета).
6. Риск-аудит как первоначальный этап процесса диагностики рисков.
7. Понятие спектра рисков.
8. Процесс определения спектра рисков предприятия, составные элементы спектра рисков.
9. Принципы оценки риска.
10. Основные методы оценки уровня рисков.
11. Задачи качественной оценки рисков.
12. Сущность и задачи количественной оценки рисков.
13. Положительные и отрицательные стороны конкретных методов оценки рисков.
14. Метод оценки хозяйственных рисков по аналогии.
15. Особенности статистического метода диагностики рисков.
16. Основные средства измерения риска.
17. Дисперсия и среднеквадратичное отклонение как простейшие количественные показатели риска.
18. Работа с реальными данными: измерение доходности, выборочные оценки.
19. Оценка горизонта прогноза.
20. Понятие «стоимости под риском» (Value At Risk, VAR).
21. Показатель VAR как основная мера риска. Три основных метода вычисления VAR: аналитический (иначе называемый методом вариации-ковариации), историческое моделирование и статистическое моделирование (метод Монте-Карло). Понятие VAR для портфеля.
22. Особенности метода экспертных оценок.

## **Методические рекомендации по подготовке к экзамену**

Экзамен - важные этапы в учебном процессе, имеющие целью проверку знаний, выявление умений применять полученные знания к решению практических задач. Как подготовка к экзамену, так и сам экзамен - форма активизации и систематизации полученных знаний, их углубления и закрепления. Подготовка к экзаменам для студентов, особенно заочной формы обучения, всегда осложняется дефицитом времени.

Для экзамена необходимо следующее: экзаменационные вопросы; материалы курса; ваши КР; ваши записи; ваш преподаватель; ваша учебная группа; учебные занятия.

Рекомендуем воспользоваться общими советами.

1. Используйте экзаменационные вопросы. Это даст Вам верное представление о том, что нужно ожидать на экзамене. Попрактикуйтесь в написании ответов на вопросы, стараясь уложиться в отведённое время, но при этом имейте под руками материалы курса, чтобы проверить Вашу память на относящиеся к делу идеи и концепции.

2. Используйте материалы курса. У Вас будут хорошие шансы сдать экзамен успешно, если Вы используете материалы курса в Ваших ответах на экзаменационные вопросы. Просмотрите все книги. Сделайте свежие записи. Выпишите некоторые ключевые слова, имена, методы и повесьте на видном месте. Постарайтесь бегло просмотреть основные идеи курса, когда у Вас появится некоторое время для обдумывания. Найдите цели и выводы в каждом разделе - они обычно содержат основные результаты и составят основу для экзаменационных вопросов.

3. Прибегните к помощи Вашего преподавателя и других студентов Вашей группы.

4. Используйте лекции и учебные занятия для подготовки к экзамену.

Экзаменаторы хотят проверить, насколько хорошо Вы понимаете содержание курса и можете ли Вы применить его в соответствующей ситуации. Посмотрите на вопросы в экзаменационном листе. Какую часть курса они

включают? Можете ли Вы очень кратко объяснить теорию или идею и применить их в вашем ответе на эти частные вопросы? Воспользуйтесь множеством ссылок на идеи курса. Это продемонстрирует, что Вы поняли и можете применять их. Если Вы сумеете придать значение всему перечисленному выше, то Вы должны сдать экзамен. Но, ради себя самого прочтите вопрос, убедитесь, что Вы понимаете, о чём Вас спрашивают, и затем подготовьте свой ответ.

На экзамене Вы будете находиться в напряжённых условиях, так как Вы будете ограничены во времени. И, возможно, Вы будете ощущать некоторую обеспокоенность, так как у Вас не будет материалов курса, которые могли бы Вам помочь. Давайте сначала рассмотрим, как справиться с чувством беспокойства, хотя такие ощущения вполне нормальны для подобных ситуаций. Однако Вы можете обратить их себе на пользу. Повышенная выработка адреналина в действительности может помочь Вам в успешном выполнении, но Вы не должны позволять Вашему беспокойству слишком сильно овладевать Вами и вводить Вас в состояние паники. Ниже приведены некоторые приемы, которые могут помочь Вам справиться со стрессом:

- ⇒ возьмите себя в руки, сделайте несколько глубоких вдохов, чтобы восстановить дыхание;
- ⇒ тщательно прочтите вопросы экзаменационного билета, так как, если Вы их неправильно поймёте, Вы можете потерять шанс на успешную сдачу экзамена;
- ⇒ медленно прочтите содержание вопросов, прежде чем решить, что делать дальше;
- ⇒ решите, как Вы распределите Ваше время;
- ⇒ точно определите, что требуется для ответа на вопрос, потому что маловероятно, что в ответе потребуется написать всё, что Вы знаете об этой проблеме. Неправильный ответ на вопрос является наиболее частой причиной неудач на экзамене;

- ⇒ положите в основу или "высветите" какие-либо ключевые слова из вопроса, которые будут действовать как указатели, для получения ответа, удовлетворяющего требованиям;
- ⇒ спланируйте и представьте Ваши ответы в таком же строгом виде, как Вы это делали в ваших КР, но не забывайте, что в итоге это должны быть более короткие ответы;
- ⇒ чтобы преодолеть свою нервозность и начать выполнение, Вы можете применить методы, которыми Вы пользовались при выполнении Ваших КР: припомните все идеи, начертите диаграммы или используйте любые из привычных Вам по выполнению КР способов. Сам факт перемещения ручки или карандаша по бумаге подвигнет Вас к действиям, обычно вслед за этим следует творческий процесс;
- ⇒ по мере развития Вашего ответа обратитесь вновь к вопросу и Вашему плану и проверьте, не уклонились ли Вы от первоначального направления;
- ⇒ держите рядом с собой часы, так как очень легко потратить чересчур много времени на более лёгкие вопросы, а Вы должны ответить на требуемое количество вопросов для успешной сдачи экзамена;
- ⇒ пишите разборчиво;
- ⇒ кратко объясняйте теорию/ концепцию, чтобы показать, что Вы понимаете их и можете применить их соответствующим образом к ситуации, описанной в вопросе;
- ⇒ и наконец, убедитесь, что Вы оставили достаточно времени на то, чтобы прочитать Ваш ответ и исправить любые очевидные ошибки прежде, чем кончится экзамен.

Хорошее планирование и разумный контроль ситуации обычно приводят к успеху на экзамене.

При неблагоприятном стечении обстоятельств, ведущем к провалу на экзамене, помните, что это ещё не конец света. Вы приобрели какую-то часть

знаний, и это само по себе является удачей, так как Вы сможете применить их в Вашей работе в дальнейшем. И обычно имеется второй шанс попытаться сдать экзамен позже.

### **Критерии оценки знаний при сдаче экзамена**

Экзамен по дисциплине сдается по экзаменационным билетам, куда входят два вопроса по дисциплине.

Контроль сроков выполнения заданий, качества работы, спектр поисковой работы с библиографическим массивом ведется преподавателем в демократическом режиме без жесткого авторитарного давления и напоминаний. Работы, не выполненные в срок, не засчитываются. Сам студент должен быть заинтересован в своей личной успеваемости и следить за сроками и качеством представляемых к проверке работ.

Положительная оценка выставляется в том случае, если студентами выполняются все приоритетные и дополнительные виды работ, как в устной, так и письменной форме.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется в том случае, если студенты систематически пропускают занятия и не восполняют пропуск проделанных работ.

### **ВОПРОСЫ ДЛЯ САМОКОНТРОЛЯ:**

1. Что такое риск?
2. Как различаются понятия «риск» и «неопределенность»?
3. В чем различие объективного и субъективного понимания риска?
4. Каковы структурные характеристики риска?
5. Каким образом связаны риск, доходность и ликвидность?
6. Почему необходимо классифицировать риски?
7. Почему выделяются различные критерии классификации рисков?
8. Какие критерии классификации рисков существуют?
9. По каким классификационным признакам производится классификация рисков?

- 10.С помощью каких показателей можно произвести количественную оценку риска?
- 11.Как оценивается горизонт прогноза?
- 12.Какие риски можно оценивать при помощи показателя VAR?
- 13.Какие методы применяются для расчета показателя VAR?
- 14.В каких случаях применяются эвристические методы оценки рисков?
- 15.Какие методы управления рисками существуют? Каким процедурам управления рисками они соответствуют?
- 16.Охарактеризуйте основные методы управления рисками.
- 17.Какие методы финансирования рисков существуют?
- 18.В чем проявляется системный характер риск-менеджмента?
- 19.Каковы основные цели системы управления рисками?
- 20.Какие внешние и внутренние ограничения системы управления рисками существуют?

## VII. Материально-техническое обеспечение

Наименование специальных* помещений	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Перечень лицензионного программного обеспечения. Реквизиты подтверждающего документа
<p>Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации,</p> <p>Учебная аудитория № 218 (170002 Тверская обл., г. Тверь, Садовый пер., д. 35)</p>	<p>1. Комплект учебной мебели на 25 посадочных мест.</p> <p>2. Экран настенный Screen Media 153x203</p> <p>3. Переносной комплект мультимедийной техники (ноутбук, проектор).</p> <p>4. Меловая доска</p>	<p>Microsoft Windows 10 Enterprise - Акт на передачу прав №1051 от 05.08.2020 г.</p> <p>MS Office 365 pro plus - Акт на передачу прав №1051 от 05.08.2020 г.</p> <p>Acrobat Reader DC - бесплатно</p> <p>Google Chrome – бесплатно</p>

## VIII. Сведения об обновлении рабочей программы дисциплины

№ п.п.	Обновленный раздел	Описание внесенных	Реквизиты документа,
--------	--------------------	--------------------	----------------------



	рабочей программы дисциплины	изменений	утвердившего изменения
1.			
2.			