

Автономная некоммерческая организация
высшего образования



Уральский институт фондового рынка

Кафедра финансов, учета и ценных бумаг

УТВЕРЖДАЮ:

Проректор по учебной работе

 М.В. Рожкова

«29» августа 20 19 г.

Рабочая программа дисциплины

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ИННОВАЦИОННОГО ПРОЕКТА

Направление подготовки

38.04.01. «Экономика»
(код и наименование направления подготовки)

Направленность (профиль) программы Экономика и финансы инновационной компании
(наименование магистерской программы)

Форма обучения

очная, заочная, очно-заочная

Екатеринбург

2019

УДК

ББК

Б

Управление рисками инновационного проекта: Рабочая программа. - Екатеринбург: УИФР, 2019. – 26 с.

Рабочая программа как базовый элемент учебно-методического комплекса дисциплины. Составлена на основании ФГОС ВО и учебных планов УИФР по указанным направлениям и профилям подготовки.

Составитель рабочей программы Алмазова О.Н., Болотин Е.Г.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры Финансов, учета и ценных бумаг.

© Уральский институт фондового рынка, 2019.

Учебное издание

Формат 60X90/16. Гарнитура Times New Roman

Усл. п.л. _____ Изд. № _____ – 2019. Тираж _____ экз.

Заказ № _____

Отпечатано в Уральском институте фондового рынка

Содержание

Раздел 1. Программно-методические материалы	4
1.1 Общая характеристика дисциплины.....	4
1.2 Место дисциплины в структуре образовательной программы.....	4
1.3 Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы.....	5
1.4 Тематический план изучения дисциплины	8
1.5 Учебно-методическое обеспечение дисциплины.....	10
Раздел 2. Практические материалы.....	11
2.1 Темы семинарских занятий	11
2.2. Тематики лабораторных практикумов	12
2.3 Самостоятельная работа студентов	12
Раздел 3. фонд оценочных средств для проведения аттестации обучающихся по дисциплине	18
3.1 Оценочные средства (вопросы) для самоконтроля и текущего контроля.....	18
3.2 Оценочные средства (вопросы) для зачета	20
3.3 Перечень тем рефератов и докладов на семинарах	21
3.4 Особенности проведения текущей и промежуточной аттестации для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов.....	21
Раздел 4. Методические рекомендации преподавателям по организации обучения и материально-техническая база, необходимая для освоения дисциплины.....	22
4.1 Образовательные технологии.....	22
4.2. Критерии оценок текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины	22
4.3. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине	25
ЛИСТ РЕГИСТРАЦИИ ИЗМЕНЕНИЙ В РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ	26

РАЗДЕЛ 1. ПРОГРАММНО-МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ

1.1 Общая характеристика дисциплины

Дисциплина «Управление рисками инновационного проекта» включена в раздел дисциплин по выбору блока Б.1.

Дисциплина является необходимой в подготовке магистров экономики и призвана сформировать у студентов целостную систему теоретических знаний, практических умений и навыков в области управления рисками инновационного проекта, необходимых для освоения образовательной программы прикладной магистратуры по направлению «Экономика».

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Код	Содержание
ПК-6	способность оценивать эффективность проектов с учетом фактора неопределенности
ПК-10	способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом

1.2 Место дисциплины в структуре образовательной программы

Цель изучения дисциплины - является обучение студентов навыкам анализа, оценки и управления рисками инновационных проектов с возможностью практического использования полученных знаний, умений и навыков при разработке и принятии управленческих решений в условиях неопределенности.

Задачи курса:

- ознакомление студентов с экономической сущностью неопределенности и рисков, классификацией рисков;
- раскрытие методов управления рисками инновационных проектов;
- формирование навыков анализа, прогнозирования и оценки рисков инновационных проектов;
- расширение навыков оценки эффективности с учетом рисков и неопределенности на всех этапах управления рисками инновационных проектов;
- приобретение навыков самостоятельного управления рисками инновационных проектов.

Общая трудоемкость дисциплины «Управление рисками инновационного проекта» составляет 3 зачетные единицы, 108 часов.

Для успешного освоения дисциплины необходимы базовые знания по следующим курсам: «Микроэкономика (продвинутый уровень)», «Эконометрика (продвинутый уровень)», «Экономика и финансы инновационной компании».

Итогом освоения данной дисциплины является формирование знаний, умений и навыков в области управления рисками инновационных проектов, поэтому ее изучение необходимо для успешного прохождения производственной (в том числе преддипломной) практик, а также для подготовки выпускной квалификационной работы магистра.

Темы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами и практиками

№ п/п	Наименование обеспечиваемых (последующих) дисциплин	№ тем данной дисциплины, необходимых для изучения обеспечиваемых (последующих) дисциплин					
		1	2	3	4	5	6
1.	Производственная (в том числе преддипломная) практика	+	+	+	+	+	+
2.	Подготовка ВКР	+	+	+	+	+	+

1.3 Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

В результате изучения дисциплины и освоения соответствующих компетенций, соотнесенными с планируемыми результатами освоения образовательной программы по направлению подготовки, студент должен:

Знать:

- сущность неопределенности и рисков, в том числе инновационных проектов, причины их проявления, виды рисков, их влияние на эффективность проектов (ПК-6);

- принципы и методы анализа рисков, методы оценки и прогнозирования рисков, методы управления рисками (ПК-10);

Уметь:

- анализировать и моделировать развитие инновационной деятельности в условиях риска, оценивать эффективность инновационных решений тактического и стратегического характера в условиях неопределенности и риска (ПК-6);

- разрабатывать прогнозы эффективности мероприятий по страхованию рисков, уклонению от рисков и минимизации рисков, (ПК-10).

Владеть:

- навыками проведения экспертизы эффективности инновационных проектов с учетом фактора неопределенности и рисков (ПК-6);

- навыками прогнозирования в условиях неопределенности рисков при разработке проектных решений и оценки их эффективности (ПК-10).

Взаимосвязь компетенций с учебным материалом и вопросами для промежуточной аттестации

Компетенции	Лекции	Семинары	№ вопроса
ПК-6	1-4	1-4	1-8
ПК-10	5, 6	5, 6	9 – 26

Текущий контроль по дисциплине обеспечивает оценивание хода освоения дисциплины. Он осуществляется в процессе проведения учебных занятий. Текущий контроль может реализоваться в форме опроса.

Промежуточная аттестация обучающихся по дисциплине обеспечивает оценивание промежуточных и окончательных результатов обучения по дисциплине. **Промежуточная аттестация реализуется в форме зачета.**

Результаты освоения дисциплины достигаются за счет использования в процессе обучения активных и интерактивных методов и технологий формирования заданных компетенций у студентов.

Объем дисциплины и виды учебной работы

Виды учебной работы	Формы обучения		
	Очная	Заочная	Очно-заочная
Общая трудоемкость	108	108	108
Контактная работа, включая текущий контроль:	29	15	23
➤ Занятия лекционного типа (Лекции)	8	4	6
➤ Занятия семинарского типа (Семинары)	20	10	16
➤ Промежуточная аттестация (ПА)	1	1	1
Самостоятельная работа (СР)	79	93	85

Распределение часов дисциплины по темам и видам работ

ОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

№ п/п	Разделы и темы дисциплины	Всего, час	Виды учебной работы и трудоемкость (в часах)		
			Лекции	Семинары	Самостоятельная работа
1.	Экономическая сущность и классификация рисков	17	1	3	13
2.	Виды рисков инновационных проектов	16	1	2	13
3.	Случайные события. Вероятности. Законы распределений	18	2	3	13
4.	Методы оценки эффективности проектов и управления рисками	19	2	4	13
5.	Основные методы анализа и прогнозирования рисков	18	1	4	13
6.	Оценка рисков инновационных проектов	19	1	4	14
ИТОГО		107	8	20	79

ЗАОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

№ п/п	Разделы и темы дисциплины	Всего, час	Виды учебной работы и трудоемкость (в часах)		
			Лекции	Семинары	Самостоятельная работа
1.	Экономическая сущность и классификация рисков	16,5	0,5	1	15
2.	Виды рисков инновационных проектов	16,5	0,5	1	15
3.	Случайные события. Вероятности. Законы распределений	18	1	2	15
4.	Методы оценки эффективности проектов и управления рисками	19	1	2	16
5.	Основные методы анализа и прогнозирования рисков	18,5	0,5	2	16
6.	Оценка рисков инновационных проектов	18,5	0,5	2	16
ИТОГО		107	4	10	93

ОЧНО-ЗАОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

№ п/п	Разделы и темы дисциплины	Всего, час	Виды учебной работы и трудоемкость (в часах)		
			Лекции	Семинары	Самостоятельная работа
1.	Экономическая сущность и классификация рисков	17	1	2	14
2.	Виды рисков инновационных проектов	17	1	2	14
3.	Случайные события. Вероятности. Законы распределений	18	1	3	14
4.	Методы оценки эффективности проектов и управления рисками	18	1	3	14
5.	Основные методы анализа и прогнозирования рисков	18	1	3	14
6.	Оценка рисков инновационных проектов	19	1	3	15
ИТОГО		107	6	16	85

1.4 Тематический план изучения дисциплины

№ темы	Наименование темы	Содержание
1.	Экономическая сущность и классификация рисков	Понятие риска. Теория рисков. Неопределенность и риск. Фактор неопределенности. Оценка полезности и меры риска. Шанс и риск. Риск инновационной деятельности. Источники неопределенности инвестиционной деятельности. Сущность управления рисками. Цикл управления рисками инновационной деятельности. Задачи управления рисками в инновационной деятельности. Последствия реализации рисков и их социально-экономические эффекты.
2.	Виды рисков инновационных проектов	Виды рисков. Чистые риски. Спекулятивные риски. Природно-естественные риски. Экологические риски. Политические риски. Транспортные риски. Имущественные риски. Производственные риски. Торговые риски. Финансовые риски. Риски, связанные с покупательной способностью денег

		(purchasing power): инфляционные, дефляционные, валютные, риск ликвидности. Риски, связанные с вложением капитала – инвестиционные (investment).
3.	Случайные события. Вероятности. Законы распределений	Особенности использования аппарата математической статистики и теории вероятности при оценке риска. Стохастические методы моделирования. Оценка меры риска. Зоны риска: зона допустимого, умеренного, высокого, недопустимого риска. Безрисковая зона. Графики Лоренца. Уровень рискованности проекта. Общая оценка риска проекта. Правило поглощения рисков. Правило математического сложения рисков. Правило логического сложения рисков.
4.	Методы оценки эффективности проектов и управления рисками	Теория управления рисками и оценка эффективности. Цели и задачи управления рисками. Принципы и стратегии управления рисками. Методы управления рисками. Метод распределения рисков. Метод диверсификации. Метод лимитирования. Метод страхования и хеджирования. Виды страхования рисков. Организационно-управленческие условия управления рисками, их эффективность. Методы оценки эффективности проектов и управления рисками в деятельности служб организаций различных форм собственности.
5.	Основные методы анализа и прогнозирования рисков	Принципы анализа и прогнозирования рисков. Идентификация возможных областей возникновения рисковых ситуаций. Прямые и косвенные показатели оценки риска. Метод аналогии в управлении риском. Метод балльной оценки риска. Определение списка факторов, определяющих степень риска проекта. Разработка состава показателей, характеризующих влияние и риск (или их соотношение) в области проявления каждого фактора. Оценка влияния каждого показателя по Метод дерева решений в управлении риском. Метод Монте–Карло (статистических испытаний). Методы экспертных оценок риска. Метод Дельфи. Коэффициент конкордации (согласованности) мнений экспертов. Методы портфолио. Моделирование риска.
6.	Оценка рисков инновационных проектов	Оценка риска и формирование прогнозов. Качественная оценка риска и возможности ее применения. Количественная оценка риска и возможности

		ее применения. Собственный риск проекта. Корпоративный, или внутрифирменный, риск. Рыночный риск. Метод корректировки нормы дисконта с учетом риска. Метод достоверных эквивалентов (коэффициентов определенности). Анализ чувствительности критериев эффективности. Использование Excel для анализа чувствительности критериев эффективности. Метод сценариев. Прогноз вариантов изменений ключевых исходных показателей (пессимистический, наиболее вероятный и оптимистический). Анализ вероятностных распределений полученных результатов.
--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

1.5 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

1.5.1 Основная литература

Черняк, В. З. Управление инвестиционными проектами [Электронный ресурс] : учебное пособие для вузов / В. З. Черняк. — Электрон. текстовые данные. — М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2015. — 364 с. — 5-238-00680-2. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/52060.html>

1.5.2 Дополнительная литература

1. Управление инвестиционными проектами в условиях риска и неопределенности [Электронный ресурс] : учебное пособие / Л. Г. Матвеева, А. Ю. Никитаева, О. А. Чернова, Е. Ф. Щипанов. — Электрон. текстовые данные. — Ростов-на-Дону : Издательство Южного федерального университета, 2015. — 299 с. — 978-5-9275-1788-6. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/78712.html>

1.5.4. Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимые для освоения дисциплины

Лицензионные ресурсы:

Электронно-библиотечная система: по паролю. URL: <http://www.iprbookshop.ru/> Предусмотрен режим для слабовидящих.

1.5.5. Программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы (информационные технологии), используемые при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

1.Офисный пакет программ MicrosoftOffice, включающий текстовый редактор MicrosoftWord, электронную таблицу MicrosoftExcel, программу для подготовки презентаций MicrosoftPowerPoint, браузер InternetExplorer;

2. Информационная справочная система «ГАРАНТ» <http://www.garant.ru/> (доступ по паролю);

3. Студенческий информационный портал "Гарант-Образование" <https://edu.garant.ru/> (доступ свободный);

4. Научная электронная библиотека – база данных eLIBRARY.RU <https://elibrary.ru/defaultx.asp> (доступ свободный);

5. Центральная база данных Росстата - <https://www.gks.ru/dbscripts/cbsd/> (доступ свободный);

6. Scopus – единая база данных рецензируемой научной литературы. www.scopus.com (доступ свободный);

7. Открытые базы данных Минфина России <https://www.minfin.ru/ru/opendata/> (доступ свободный).

1.5.6. Особенности учебно-методического обеспечения для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Студенты с ограниченными возможностями здоровья, в отличие от остальных студентов, имеют свои специфические особенности восприятия, переработки материала. Подбор и разработка учебных материалов для таких студентов производится с учетом того, чтобы предоставлять этот материал в различных формах так, чтобы инвалиды с нарушениями слуха получали информацию визуально, с нарушениями зрения - аудиально. Предусмотрено в случае необходимости создание текстовой версии любого нетекстового контента для его возможного преобразования в альтернативные формы, удобные для различных пользователей, альтернативную версию медиаконтентов, предусмотрена возможность масштабирования текста и изображений без потери качества, предусмотрена доступность управления контентом с клавиатуры.

РАЗДЕЛ 2. ПРАКТИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ

2.1 Темы семинарских занятий

№ п/п	Наименование темы	Виды занятий (с указанием конкретных форм)
1.	Экономическая сущность и классификация рисков	Определение (в виде аналитического обзора) экономической сущности и видов риска. Доклад на тему «Экономическая сущность и виды рисков»
2.	Виды рисков инновационных проектов	Сравнительный анализ основных видов рисков, возникающих в процессе реализации и оценки эффективности инновационных проектов.
3.	Случайные события. Ве-	1. Оценка зависимости риска и рентабельности с использованием моделей финансового арбитража (Л/Т-модель).

	ростности. Законы распределений	2. Экономический смысл показателей ковариации и коэффициента корреляции применительно к процессу долгосрочного инвестирования.
4.	Методы оценки эффективности проектов и управления рисками	1. Методы экспертных оценок эффективности. Метод Дельфи. Коэффициент конкордации (согласованности) мнений экспертов. 2. Методы портфолио. 3. Моделирование риска.
5.	Основные методы анализа и прогнозирования рисков	Анализ чувствительности проекта на основе расчета NPV); Анализ точки безубыточности проекта; Оценка риска с использованием метода эквивалентов определенности. Дискуссия «Преимущества и недостатки основных методов анализа и прогнозирования рисков»
6.	Оценка рисков инновационных проектов	Определение ожидаемых (пессимистических и оптимистических) оценок возможных результатов реализации инвестиционного проекта; Аналитическое заключение и прогноз по характеристике уровня рискованности представленного варианта капитальных вложений.

2.2. Тематики лабораторных практикумов

Лабораторный практикум не предусмотрен.

2.3 Самостоятельная работа студентов

2.3.1 Виды самостоятельной работы студентов и перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся

№ п/п	Темы дисциплины	Виды самостоятельной работы
1.	Экономическая сущность и классификация рисков	- проработка учебного материала (по конспектам лекций, учебной литературе и нормативно-правовым документам); - работа в электронной библиотечной системе; - подготовка доклада на тему «Экономическая сущность и виды рисков» - работа с вопросами для самопроверки

		- подготовка к зачету.
2.	Виды рисков инновационных проектов	- проработка учебного материала (по конспектам лекций, учебной литературе и нормативно-правовым документам); - работа в электронной библиотечной системе; - подготовка к зачету.
3.	Случайные события. Вероятности. Законы распределений	- проработка учебного материала (по конспектам лекций, учебной литературе и нормативно-правовым документам); - работа в электронной библиотечной системе; - подготовка к зачету.
4.	Методы оценки эффективности проектов и управления рисками	- проработка учебного материала (по конспектам лекций, учебной литературе и нормативно-правовым документам); - работа в электронной библиотечной системе; - подготовка к зачету.
5.	Основные методы анализа и прогнозирования рисков	- проработка учебного материала (по конспектам лекций, учебной литературе и нормативно-правовым документам); - работа в электронной библиотечной системе; - подготовка к зачету.
6.	Оценка рисков инновационных проектов	- проработка учебного материала (по конспектам лекций, учебной литературе и нормативно-правовым документам); - работа в электронной библиотечной системе; - подготовка к зачету.

2.3.2 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Самостоятельная работа студентов развивает самостоятельность мышления, способствует формированию научных интересов, приобретению навыков самостоятельной работы с литературой, приобщает к научно-исследовательской деятельности, помогает освоить практику написания научных трудов, технику научной работы, работы со специализированным программным обеспечением, приемы оформления текста рукописи и т. д.

Семинарские и практические занятия в значительной степени ориентируются на применение полученных во время лекции знаний, на отработку и систематизацию предметных и общеучебных способов деятельности (умений), способов оптимального поиска и переработки информации. Самостоятельные работы студентов с использованием опорных методических материалов (методические рекомендации, методические указания, тетради на печатной основе, инструкции, алгоритмические предписания в содержании информационных

технологий и др.) задают ориентировочную основу учебной деятельности, позволяют оперативно корректировать их работу, оказывать индивидуальную помощь и поддержку, совершенствовать ее качество. Все это в конечном итоге позволяет на основе оперативной обратной связи повысить управляемость учебным процессом.

Подготовку к каждому семинарскому занятию каждый студент должен начать с ознакомления с планом семинарского занятия, который отражает содержание предложенной темы. Тщательное продумывание и изучение вопросов плана основывается на проработке текущего материала лекции, а затем изучения обязательной и дополнительной литературы, рекомендованную к данной теме. На основе индивидуальных предпочтений студенту необходимо самостоятельно выбрать тему доклада по проблеме семинара и по возможности подготовить по нему презентацию. Если программой дисциплины предусмотрено выполнение практического задания, то его необходимо выполнить с учетом предложенной инструкции (устно или письменно). Все новые понятия по изучаемой теме необходимо выучить наизусть и внести в глоссарий, который целесообразно вести с самого начала изучения курса. Результат такой работы должен проявиться в способности студента свободно ответить на теоретические вопросы семинара, его выступлении и участии в коллективном обсуждении вопросов изучаемой темы, правильном выполнении практических заданий и контрольных работ.

Структура семинара

В зависимости от содержания и количества отведенного времени на изучение каждой темы семинарское занятие может состоять из четырех-пяти частей:

1. Обсуждение теоретических вопросов, определенных программой дисциплины.
2. Доклад и/ или выступление с презентациями по проблеме семинара.
3. Обсуждение выступлений по теме – дискуссия.
4. Выполнение практического задания с последующим разбором полученных результатов или обсуждение практического задания, выполненного дома, если это предусмотрено программой.
5. Подведение итогов занятия.

Первая часть – обсуждение теоретических вопросов - проводится в виде фронтальной беседы со всей группой и включает выборочную проверку преподавателем теоретических знаний студентов. Примерная продолжительность — до 15 минут.

Вторая часть — выступление студентов с докладами, которые должны сопровождаться презентациями с целью усиления наглядности восприятия, по одному из вопросов семинарского занятия. Обязательный элемент доклада – представление и анализ статистических данных, обоснование социальных последствий любого экономического факта, явления или процесса.

Примерная продолжительность — 20-25 минут.

После докладов следует их обсуждение – дискуссия. В ходе этого этапа семинарского занятия могут быть заданы уточняющие вопросы к докладчикам.

Примерная продолжительность – до 15-20 минут.

Если программой предусмотрено выполнение практического задания в рамках конкретной темы, то преподавателями определяется его содержание и дается время на его выполнение, а затем идет обсуждение результатов. Если практическое задание должно было быть выполнено дома, то на семинарском занятии преподаватель проверяет его выполнение (устно или письменно).

Примерная продолжительность – 15-20 минут.

Подведением итогов семинарское занятие заканчивается. Студентам должны быть объявлены оценки за работу и даны их четкие обоснования.

Примерная продолжительность — 5 минут.

Практические советы по подготовке презентации, доклада

- готовьте отдельно: печатный текст + слайды + раздаточный материал;
- слайды – визуальная подача информации, которая должна содержать минимум текста, максимум изображений, несущих смысловую нагрузку, выглядеть наглядно и просто;
- текстовое содержание презентации – устная речь или чтение, которая должна включать аргументы, факты, доказательства и эмоции;
- рекомендуемое число слайдов 17-22;
- обязательная информация для презентации: тема, фамилия и инициалы выступающего; план сообщения; краткие выводы из всего сказанного; список использованных источников;
- раздаточный материал должен обеспечивать ту же глубину и охват, что и живое выступление: люди больше доверяют тому, что они могут унести с собой, чем исчезающим изображениям, слова и слайды забываются, а раздаточный материал остается постоянным осязаемым напоминанием; раздаточный материал важно раздавать в конце презентации.

Доклад, согласно толковому словарю русского языка Д.Н. Ушакова: «... сообщение по заданной теме, с целью внести знания из дополнительной литературы, систематизировать материал, проиллюстрировать примерами, развивать навыки самостоятельной работы с научной литературой, познавательный интерес к научному познанию».

Тема доклада должна быть согласована с преподавателем и соответствовать теме учебного занятия. Материалы при его подготовке, должны соответствовать научно-методическим требованиям вуза и быть указаны в докладе. Необходимо соблюдать регламент, оговоренный при получении задания. Иллюстрации должны быть достаточными, но не чрезмерными. Работа студента над докладом-презентацией включает отработку умения самостоятельно обобщать материал и делать выводы в заключение, умения ориентироваться в материале и отвечать на дополнительные вопросы слушателей, отработку навыков ораторства, умения проводить диспут.

Докладчики должны знать и уметь:

сообщать новую информацию; использовать технические средства; хорошо ориентироваться в теме всего семинарского занятия; дискутировать и быстро отвечать на заданные вопросы; четко выполнять установленный регламент (не более 10 минут); иметь представление о композиционной структуре доклада и др.

Структура выступления

Вступление помогает обеспечить успех выступления по любой тематике. Вступление должно содержать: название, сообщение основной идеи, современную оценку предмета изложения, краткое перечисление рассматриваемых вопросов, живую интересную форму изложения, акцентирование внимания на важных моментах, оригинальность подхода.

Основная часть, в которой выступающий должен глубоко раскрыть суть затронутой темы, обычно строится по принципу отчета. Задача основной части – представить достаточно данных для того, чтобы слушатели заинтересовались темой и захотели ознакомиться с материалами. При этом логическая структура теоретического блока не должны даваться без наглядных пособий, аудиовизуальных и визуальных материалов.

Заключение – ясное, четкое обобщение и краткие выводы, которых всегда ждут слушатели.

Виды самостоятельной работы студентов, обеспечивающие реализацию цели и решение задач данной дисциплины:

- ✓ подготовка к семинарским занятиям;
- ✓ изучение тем в рамках самостоятельной работы;
- ✓ выполнение контрольных и творческих заданий;
- ✓ подготовка и сдача экзамена.

Самостоятельная работа студентов должна способствовать более глубокому усвоению изучаемой дисциплины, формировать навыки исследовательской работы и ориентировать студентов на приобретение навыков применения теоретических знаний на практике.

Структура самостоятельной работы включает три основных этапа: подготовительный или ориентировочный, исполнительный и контрольно-диагностический. В рамках указанных этапов последовательно выполняются следующие учебные действия: анализ учебного задания и сроков его выполнения, поиск способов и средств его выполнения; планирование хода выполнения задания и прогнозирование возможных затруднений, проверка, оценка и самооценка полученных результатов. Структуру самостоятельной работы студенты не только должны знать, но и применять эти знания в своей деятельности.

Процесс изучения учебного предмета можно рассматривать как последовательное погружение студента в содержание изучаемого материала под "весом" собственных знаний. Однако в нем выделяются три этапа, качественно различных по своим задачам и видам выполняемых действий.

1-й этап Рассмотрение выделенных компонентов текста учебной литературы. Задача: понять все, что бросается в глаза и легко запоминается, и разделить текст на интересное, главное и второстепенное.

На этом этапе не требуется прилагать усилия для заучивания чего-либо. Обозревается весь учебный предмет, но пропускаются не только подробности, а даже большая часть текста. Процесс изучения начинается ознакомлением со структурой учебного материала. Она анализируется на протяжении этапа все подробнее и подробнее вплоть до первого продумывания категориального аппарата.

Перелистывать материал нужно внимательно, не пропуская страниц. Полезно задерживаться на интересном, но не останавливаться надолго, не прилагать ощутимых усилий для запоминания увиденного и прочитанного, но пытаться сопоставить его с тем, что уже знакомо, и понять его смысл. Если не получилось, то, не задерживаясь, нужно идти дальше. После того как выписаны термины и определения, следует пролистать учебник еще раз и прочесть вслух, четко произнося слова, все термины и их определения. Это поможет научиться правильно произносить новые слова.

2-й этап. Беглое чтение всего учебного материала. Задача: понять все что можно понять, не углубляясь в тщательный разбор, основное внимание уделяя теоретической части материала.

На этом этапе выполняется, беглое сквозное чтение всей теоретической части учебного материала, чтобы выявить и понять основные категории, взаимосвязи между ними. Для выполнения поставленной задачи студентам рекомендуется:

Бегло два раза прочесть всю теоретическую часть. При этом читать только основной текст, при чтении нигде не задерживаться, непонятные места пропускать, не прилагать усилия для запоминания прочитанного, стараться следить только за основным смыслом, содержанием текста. Быстро прочтя все от начала до конца, студент не успеет забыть то, что было вначале, и представит себе общую картину.

После этого студент вдумчиво должен прочесть, еще один раз, отмечая на полях непонятные места трех степеней сложности.

К первой степени сложности относят материал, который можно понять при самостоятельном разборе, так как имеется достаточно информации в той же главе. Вторую степень сложности представляет материал, который тоже можно понять самостоятельно, но для этого нужно обращаться и к другим главам учебника. К третьей степени сложности относится материал, заставляющий студента обратиться к другому источнику или к преподавателю, поскольку информации, найденной в учебнике, ему оказалось мало.

3-й этап. Медленное чтение и разбор неясных вопросов. Задача: разобраться в сложном, материале, обратить внимание на взаимосвязи между понятиями. При этом выполняются следующие действия:

Медленное чтение всего учебника и разбор непонятных вопросов первой степени сложности. При необходимости пользоваться карандашом и бумагой. Читать все, ничего не пропуская.

Медленное чтение всего учебника и разбор непонятных вопросов второй степени сложности.

Для нахождения ответов на непонятные вопросы третьей степени сложности обратиться к дополнительной литературе или к преподавателю.

Самостоятельная работа на лекции

Слушание и запись лекций – сложный вид вузовской аудиторной работы. Внимательное слушание и конспектирование лекций предполагает интенсивную умственную деятельность студента. Краткие записи лекций, их конспектирование помогает усвоить учебный материал. Конспект является полезным тогда, когда записано самое существенное, основное и сделано это самим студентом.

Не надо стремиться записать дословно всю лекцию. Такое «конспектирование» приносит больше вреда, чем пользы. Запись лекций рекомендуется вести по возможности собственными формулировками. Желательно запись осуществлять на одной странице, а следующую оставлять для проработки учебного материала самостоятельно в домашних условиях.

Конспект лекции лучше подразделять на пункты, параграфы, соблюдая красную строку. Этому в большой степени будут способствовать пункты плана лекции, предложенные преподавателям. Принципиальные места, определения, формулы и другое следует сопровождать замечаниями «важно», «особо важно», «хорошо запомнить» и т.п. Можно делать это и с помощью разноцветных маркеров или ручек. Лучше если они будут собственными, чтобы не приходилось просить их у однокурсников и тем самым не отвлекать их во время лекции.

Целесообразно разработать собственную «маркографию» (значки, символы), сокращения слов. Не лишним будет и изучение основ стенографии. Работая над конспектом лекций, всегда необходимо использовать не только учебник, но и ту литературу, которую дополнительно рекомендовал лектор. Именно такая серьезная, кропотливая работа с лекционным материалом позволит глубоко овладеть знаниями.

РАЗДЕЛ 3. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

3.1 Оценочные средства (вопросы) для самоконтроля и текущего контроля

1. Сущность и экономическая природа риска.
2. Классификация различных типов риска.
3. Характеристика и основные понятия бизнес-риска, финансового риска, общего риска компании, проектного риска, диверсифицированного риска, систематического (рыночного) риска.

4. Оценка влияния макроэкономических, специфических и финансовых факторов риска на эффективность производственно-финансовой деятельности хозяйствующего субъекта.

5. Основные подходы и способы управленческого воздействия на уровень риска и эффективность проектов.

6. Содержание и значение анализа риска в обосновании эффективности финансово-хозяйственной деятельности.

7. Цели, задачи, объекты и субъекты анализа риска и неопределенности получения запланированных результатов финансово-хозяйственной деятельности.

8. Информационная база и организационное обеспечение анализа.

9. Возможности использования новых информационных (компьютерных) технологий в анализе риска. Имитационное моделирование.

10. Методы, приемы и система показателей анализа различных типов риска в зависимости от условий финансирования и комбинации управленческих решений.

11. Использование концепции временной ценности денежных вложений и вероятностных подходов в анализе риска.

12. Использование в анализе проектного риска показателей вариации, стандартного отклонения и коэффициента вариации. Экономический смысл этих показателей.

13. Анализ показателей финансового риска. Детерминированная модель зависимости уровня финансового риска от воздействующих на него внешних и внутренних факторов.

14. Анализ ожидаемого уровня рентабельности в условиях систематического риска с использованием модели оценки капитальных активов (САРМ).

15. Оценка зависимости риска и рентабельности с использованием моделей финансового арбитража (Л/Т-модель).

16. Оценка ожидаемой рентабельности по сумме рисковых надбавок (премий) за систематический и финансовый риск.

17. Экономический смысл показателей ковариации и коэффициента корреляции применительно к процессу долгосрочного инвестирования.

18. Возможности оптимизации портфеля инвестиций. Достижимый и эффективный список портфелей инвестиций.

19. Методы экспертных оценок риска. Метод Дельфи. Коэффициент конкордации (согласованности) мнений экспертов.

20. Методы портфолио.

21. Качественная оценка риска и возможности ее применения.

22. Количественная оценка риска и возможности ее применения.

23. Назовите основные виды рисков, возникающие в процессе реализации инвестиционных проектов. Какие методы анализа собственных рисков проекта вы знаете?

24. Дайте краткую характеристику методу корректировки нормы дисконта. В чем заключаются его достоинства и недостатки?

25. В чем сущность метода коэффициентов достоверности?
26. С какой целью проводят анализ чувствительности?
27. Дайте краткую характеристику методу сценариев, назовите его основные достоинства и недостатки.
28. Назовите основные достоинства и недостатки метода анализа вероятностных распределений.
29. Приведите формулы для исчисления стандартного отклонения при условии: а) независимости потоков платежей; б) идеальной корреляции между элементами потока платежей.
30. Характеристика и область использования показателя «премия за риск».

3.2 Оценочные средства (вопросы) для зачета

1. Сущность риска и неопределенности, социально-экономические последствия реализации различных рисков
2. Объекты и факторы риска, их влияние на эффективность проектов.
3. Классификации рисков.
4. Основные стратегии и методы управления эффективностью проектов с учетом рисков.
5. Основные стандарты по управлению рисками.
6. Расчет риска на основе методологии VaR.
7. Расчет риска на основе ожидаемой полезности.
8. Показатели эффективности с учетом риска.
9. Статистические методы оценки и прогнозирования рисков.
10. Анализ чувствительности проектов.
11. Методы выявления рисков.
12. Диагностика рисков.
13. Идентификация рисков.
14. Картографирование рисков.
15. Условия и факторы выбора метода прогнозирования рисков.
16. Стратегически ориентированная система риск-менеджмента.
17. Внедрение системы риск-менеджмента.
18. Отчетность в системе риск-менеджмента.
19. Методы прогнозирования рыночных рисков.
20. Хеджирование как метод управления рыночными рисками.
21. Риски процентных ставок.
22. Показатели операционной деятельности, их роль в прогнозировании результатов проектов.
23. Методы прогнозирования и управления операционными рисками.
24. Сущность прогнозирования рисков инновационной деятельности.
25. Методы прогнозирования и управления рисками в сфере внедрения инноваций.

26. Особенности прогнозирования и управления рисками в государственных и муниципальных организациях

3.3 Перечень тем рефератов и докладов на семинарах

1. Экономическая сущность и виды рисков.
2. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.
3. Классификация рисков: виды, принципы разработки, использование.
4. Программа управления рисками: разработка и использование.
5. Комплексное использование методов управления рисками.
6. Управление рисками в малом предпринимательстве.
7. Организация управления рисками на промышленном предприятии.
8. Управление рисками инвестиционного проекта.
9. Информационное обеспечение управления рисками: принципы создания и использования информационной системы организации.
10. Методы оценки эффективности управления рисками.
11. Использование количественных методов прогнозирования и оценки рисков.
12. Использование качественных методов анализа и оценки рисков.
13. Использование превентивных мероприятий по управлению рисками.
14. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы.
15. Инновационные технологии в управлении рисками.
16. Роль субъективных факторов в управлении рисками.
17. Правовое обеспечение деятельности по управлению рисками в РФ.

3.4 Особенности проведения текущей и промежуточной аттестации для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Для осуществления процедур текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации указанных обучающихся создаются фонды оценочных средств, адаптированные для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья и позволяющие оценить достижение ими запланированных в основной образовательной программе результатов обучения и уровень сформированности всех компетенций, заявленных в образовательной программе. Такие оценочные средства создаются по мере необходимости с учетом различных нозологий. При проведении текущей и промежуточной аттестации для указанных лиц предусмотрено включение в учебный процесс различных посредников, включая тьюторов и уполномоченных по делам инвалидов. Форма проведения текущей аттестации для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов устанавливается с учетом индивидуальных психофизических особенностей (устно, письменно на бумаге, письменно на компьютере, в форме тестирования и т.п.). При необходимости таким студентам обеспечиваются соответствующие усло-

вия проведения занятий и аттестации, в том числе предоставляется дополнительное время для подготовки ответа на зачете или экзамене.

РАЗДЕЛ 4. МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПРЕПОДАВАТЕЛЯМ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ОБУЧЕНИЯ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКАЯ БАЗА, НЕОБХОДИМАЯ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

4.1 Образовательные технологии

В ходе освоения дисциплины при проведении контактных занятий используются следующие активные и интерактивные формы обучения, способствующие формированию компетенций:

ВСЕ ФОРМЫ ОБУЧЕНИЯ

№	Активные и интерактивные методы обучения	Виды учебной работы и трудоемкость (в часах)
		Семинары
1	Обсуждение доклада на тему «Экономическая сущность и виды рисков»	1
2	Дискуссия «Преимущества и недостатки основных методов анализа рисков»	1
	Итого:	2

Выбор методов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья определяется содержанием обучения, уровнем профессиональной подготовки педагогов, методического и материально-технического обеспечения, особенностями восприятия учебной информации студентов-инвалидов и студентов с ограниченными возможностями здоровья и т.д. В образовательном процессе рекомендуется использование социально-активных и рефлексивных методов обучения, технологий социокультурной реабилитации с целью оказания помощи в установлении полноценных межличностных отношений с другими студентами, создании комфортного психологического климата в студенческой группе.

4.2. Критерии оценок текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

Процедуры оценивания знаний, умений и навыков, характеризующих формирование компетенций, представлены в методических материалах вуза

«Положение об организации, формах и методах оценки качества освоения основной образовательной программы».

В рамках оценки уровня подготовленности по дисциплине применяются критерии оценивания достижений студентов в ходе текущего контроля успеваемости. Система критериев оценивания, как и при проведении промежуточной аттестации по дисциплине, опирается на три уровня освоения компонентов компетенций: пороговый, повышенный, продвинутый.

Компоненты компетенций	Признаки уровня освоения компонентов компетенций		
	пороговый	повышенный	продвинутый
Знания	Студент демонстрирует знание-знакомство, знание-копию: узнает объекты, явления и понятия, находит в них различия, проявляет знание источников получения информации, может осуществлять самостоятельно репродуктивные действия над знаниями путем самостоятельного воспроизведения и применения информации.	Студент демонстрирует аналитические знания: уверенно воспроизводит и понимает полученные знания, относит их к той или иной классификационной группе, самостоятельно систематизирует их, устанавливает взаимосвязи между ними, продуктивно применяет в знакомых ситуациях.	Студент может самостоятельно извлекать новые знания из окружающего мира, творчески их использовать для принятия решений в новых и нестандартных ситуациях.
Умения	Студент умеет корректно выполнять предписанные действия по инструкции, алгоритму в известной ситуации, самостоятельно выполняет действия по решению типовых задач, требующих выбора из числа известных методов, в предсказуемо изменяющейся ситуации	Студент умеет самостоятельно выполнять действия (приемы, операции) по решению нестандартных задач, требующих выбора на основе комбинации известных методов, в непредсказуемо изменяющейся ситуации	Студент умеет самостоятельно выполнять действия, связанные с решением исследовательских задач, демонстрирует творческое использование умений (технологий)
Навыки	Студент имеет сформированные ком-	Студент имеет сформированные	Студент имеет сформированные

	петенции как совокупность технологических и коммуникационных профессиональных качеств, позволяющих выполнять профессиональные задачи по видам деятельности на удовлетворительном уровне	компетенции как совокупность технологических и коммуникационных профессиональных качеств, позволяющих выполнять профессиональные задачи по видам деятельности на хорошем уровне	компетенции как совокупность технологических и коммуникационных профессиональных качеств, позволяющих выполнять профессиональные задачи по видам деятельности на высоком уровне
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

Кроме того, при проведении текущей и промежуточной аттестации по дисциплине в рамках традиционных форм применяются следующие критерии:

Цифровое выражение	Словесное выражение	Описание
5	Отлично (зачетно)	всестороннее, систематическое и глубокое знание учебно-программного материала, умение свободно выполнять задания, предусмотренные программой, усвоивший основную и знакомый с дополнительной литературой, рекомендованной программой. Усвоение студентом взаимосвязи основных понятий дисциплины в их значении для приобретаемой профессии, проявление творческих способностей в понимании, изложении и использовании учебно-программного материала.
4	Хорошо (зачетно)	полное знание учебно-программного материала, успешное выполнение студентом предусмотренных в программе заданий, усвоение основной литературы, рекомендованной в программе. Как правило, оценка "хорошо" выставляется студентам, показавшим систематический характер знаний по дисциплине и способным к их самостоятельному пополнению и обновлению в ходе дальнейшей учебной работы и профессиональной деятельности.
3	Удовлетворительно (зачетно)	знания основного учебно-программного материала в объеме, необходимом для дальнейшей учебы и предстоящей работы по специальности, выполнение заданий, предусмотренных программой, знакомство с основной литературой, рекомендованной программой. Как правило, оценка "удовлетворительно" выставляется студентам, допустившим погрешности в ответе на экзамене и при выполнении экзамене-

		национных заданий, но обладающим необходимыми знаниями для их устранения под руководством преподавателя.
2	Неудовлетворительно (не зачтено)	пробелы в знаниях основного учебно-программного материала, допущение студентом принципиальных ошибок в выполнении предусмотренных программой заданий. Как правило, оценка "неудовлетворительно" ставится студентам, которые не могут продолжить обучение или приступить к профессиональной деятельности по окончании вуза без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

4.3. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещение для самостоятельной работы, оснащенное компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в ЭИОС организации.

Помещения должны быть укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории (мультимедийный проектор; компьютер с выходом в интернет; экран или демонстрационный дисплей). Компьютерный класс с установленным программным обеспечением; электронная библиотека. Для проведения занятий лекционного типа предлагаются наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий, обеспечивающие тематические иллюстрации (презентации).

Особенности материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса с участием лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов различной нозологии, предусматриваются и реализуются по мере необходимости. Критерии и порядок создания таких условий указаны в Положении об организации образовательного процесса по образовательным программам для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья в Уральском институте фондового рынка.

ЛИСТ РЕГИСТРАЦИИ ИЗМЕНЕНИЙ В РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ

Номер протокола и дата заседания кафедры	Изменения
№1 от 23.08.2016	Изменение рабочей программы в связи: - с изменением организационно-юридической формы вуза, - с требованием о ежегодной актуализации методических материалов, лицензионного программного обеспечения, состава профессиональных баз данных и информационных справочных систем, литературы и оценочных средств по дисциплине.
№ 1 от 23.08.17	Актуализация методических материалов, лицензионного программного обеспечения, состава профессиональных баз данных и информационных справочных систем, литературы и оценочных средств по дисциплине
№ 1 от 22.08.18	Актуализация методических материалов, лицензионного программного обеспечения, состава профессиональных баз данных и информационных справочных систем, литературы и оценочных средств по дисциплине
№ 1 от 22.08.19	Актуализация методических материалов, лицензионного программного обеспечения, состава профессиональных баз данных и информационных справочных систем, литературы и оценочных средств по дисциплине