МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение

высшего образования

«Забайкальский государственный университет»

(ФГБОУ ВО «ЗабГУ»)

Факультет экономики и управления

Кафедра «экономики и бухгалтерского учета»

**УЧЕБНЫЕ МАТЕРИАЛЫ**

**для студентов заочной формы обучения**

по дисциплине

«Управление рисками инвестиционного проекта»

наименование дисциплины (модуля)

для направления подготовки

38.04.08 Финансы и кредит

код и наименование направления подготовки (специальности)

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) – 6 зачетных единиц.

Форма текущего контроля в семестре – контрольная работа.

Курсовая работа (курсовой проект) (КР, КП) –нет.

Форма промежуточного контроля в семестре – экзамен.

**Краткое содержание курса**

1. Неопределенность и риск
2. Факторы риска
3. Стратегии рисковых решений и основные методы управления рисками
4. Измерение риска и критерии принятия рисковых решений
5. Анализ чувствительности проектов долгосрочных инвестиций
6. Измерение риска долгосрочных инвестиционных проектов

**Форма текущего контроля**

**Контрольная работа.**

Рекомендуемый объем для контрольных работ составляет 10 – 15 страниц. Контрольная работа по дисциплине «Управление рисками инвестиционного проекта» представляет собой работу научно-методического содержания, позволяющую студенту закрепить полученную информацию, систематизируя по собственному усмотрению накопленные данные, приводя примеры по рассматриваемым вопросам. Основой содержания контрольной работы является материал, включающий обобщение, анализ теоретических положений по двум вопросам, представленным в таблице, а также собственные выводы автора.

Основными критериями для зачета выполненной контрольной работы является:

– использование достаточного объема источников (не менее 5) для рассмотрения сущности вопросов;

– навыки лаконичного, чёткого и грамотного изложения материала, оформление работы в соответствии с методическими указаниями.

**Вопросы для написания** контрольной работы выбираются студентом по первой букве своей фамилии.

|  |  |
| --- | --- |
| Первая буква фамилии | № варианта контрольной работы |
| А | 1, 50 |
| Б | 2, 49 |
| В | 3, 48 |
| Г | 4, 47 |
| Д | 5, 46 |
| Ж | 6, 45 |
| З | 7, 44 |
| И | 8, 29 |
| Е | 9, 30 |
| Ё | 10, 31 |
| К | 11, 32 |
| Л | 12, 33 |
| М | 13, 34 |
| Н | 14, 35 |
| О | 15, 36 |
| П | 16, 37 |
| Р | 17, 38 |
| С | 18, 39 |
| Т | 19, 40 |
| У | 20, 41 |
| Ф | 21, 42 |
| Х | 22, 43 |
| Ц | 23, 44 |
| Ч | 24, 45 |
| Ш | 25, 46 |
| Щ | 51; 47 |
| Э | 26, 48 |
| Ю | 27, 49 |
| Я | 28, 50 |

**Темы вопросов контрольных работ по дисциплине «Управление рисками инвестиционного проекта»**

1. Риск: сущность, функции и природа возникновения.
2. Эволюция подходов к проблеме сущности риска.
3. Классификация рисков.
4. Стадии развития риска.
5. Неопределенность: сущность и характеристики.
6. Чистые и спекулятивные риски.
7. Внешние и внутренние риски.
8. Стратегический риск: сущность, классификация
9. Макроэкономические и политические риски.
10. Риски усиления конкуренции.
11. Операционные риски: сущность, факторы возникновения.
12. Технические и технологические риски.
13. Риски информационных систем и технологий.
14. Финансовый риск: сущность, особенности, классификация
15. Управление финансовыми рисками.
16. Валютный риск и его особенности.
17. Риск ликвидности.
18. Риск упущенной выгоды.
19. Сущность природных рисков и их особенности.
20. Экологические риски: особенности и факторы их вызывающие.
21. Поведенческие риски: характеристики, особенности возникновения.
22. Кадровые риски.
23. Риски конфликтов.
24. Психологические аспекты управления рисками.
25. Методы диагностики рисков.
26. Понятие картографирования рисков.
27. Рисковый спектр и профиль: сущность и особенности.
28. Методы, применяемые при оценке риска.
29. Количественные и качественные методы оценки риска.
30. Экспертные методы оценки рисков.
31. Основные методы оценки рисков.
32. Основные методы управления рисками.
33. Самострахование и резервирование риска.
34. Лимитирование и минимизация риска.
35. Особенности выбора метода управления рисками.
36. Служба управления рисками: место в организационной структуре компании и основные задачи.
37. Базовые понятия финансовой математики в управлении рисками.
38. Стохастический подход и методы оценки рисков.
39. Теоретико-игровые модели в оценке рисков.
40. Элементы регрессионного анализа и статистического моделирования в прогнозировании и в оценке рисков.
41. Портфельный подход в управлении рисками.
42. Производные финансовые инструменты, стратегии их применения
43. Риск выбора банка.
44. Судебные, бухгалтерские и налоговые риски.
45. Риски применения ошибочных схем налоговой оптимизации.
46. Основные понятия теории стоимости управления.
47. Риски потери капитала и ресурса влияния.
48. Риски снижения рентабельности управления.
49. Риски некомпетентности и непрофессионализма. Риски саботажа.
50. Стресс-тестинг

**Общие требования к содержанию и оформлению контрольной работы**

**Общие требования к оформлению работ**

Контрольная работа выполняется, как правило, машинописным или компьютерным способом. Текст помещается на одной стороне листа формата А-4, печатается через полуторный междустрочный интервал с применением 14-го размера шрифта. Текст должен быть отформатирован по ширине страницы.

Каждая страница имеет одинаковые поля: размер левого поля - 30 мм, правого - 10 мм, верхнего - 20 мм, нижнего - 20 мм. Абзацный отступ должен быть одинаковым и равен 1,25.

Работа начинается с титульного листа, затем идет ОСНОВНОЙ ТЕКСТ и СПИСОК ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ИСТОЧНИКОВ.

Нумерация страниц начинается с титульного листа, на котором цифра «1» не проставляется. Порядковый номер печатается справа внизу страницы. Работа выполняется в единой стилевой манере, не допускаются грамматические, пунктуационные, стилистические ошибки и опечатки.

Ссылки можно указывать в квадратных скобках с номером источника по списку, например, [4], [4, С. 67-78].

**Оформление письменной работы согласно МИ-01-02-2018**

[Общие требования к построению и оформлению учебной текстовой документации](https://zabgu.ru/files/html_document/pdf_files/fixed/Normativny%27e_dokumenty%27/MI__01-02-2018_Obshhie_trebovaniya_k_postroeniyu_i_oformleniyu_uchebnoj_tekstovoj_dokumentacii.pdf)

***Перечень теоретических вопросов (для оценки знаний):***

***Типовые вопросы для оценки знаний***

1. Управление рисками в системе наук управления.
2. Понятие риска и его природа. Развитие взглядов на риски.
3. Аспекты риска.
4. Основные виды рисков и их характеристика.
5. Развитие взглядов на управление риском.
6. Способы управления рисками и их содержание.
7. Инструменты манипулирования рисками.
8. Издержки и доходы управления риском.
9. Базовые понятия финансовой математики в управлении рисками.
10. Количественные и качественные методы оценки рисков.
11. Стохастический подход и методы оценки рисков.
12. Теоретико-игровые модели в оценке рисков.
13. Элементы регрессионного анализа и статистического моделирования в прогнозировании и в оценке рисков.
14. Риски и неопределенность. Стратегия и риски компании.
15. Риски внешней и внутренней среды организации.
16. Этапы жизненного цикла и динамика рисков компании.
17. Многомерность управления компанией.
18. Многомерность рискового пространства.
19. Развитие компании и управление рисками.
20. Функция управления риском.
21. Диагностика рисков компании. Формат идентификации рисков.
22. Рисковые спектр и профиль.
23. Методы диагностики рисков компании.
24. Картографирование рисков фирмы.
25. Стратегические риски.
26. Макроэкономические и политические риски компании.
27. Риски изменения законодательства и системы налогообложения.
28. Методы интеграции и совокупное покрытие рисков.
29. Альянсы и неопределенности. Риски отношений в альянсах.
30. 30. Риски усиления конкуренции в условиях спада.
31. Основные операционные риски финансовых организаций.
32. Основные операционные риски промышленных компаний.
33. Технологические риски.
34. Риски информационных систем и технологий.
35. Портфельный подход в управлении рисками.
36. Основные виды финансовых рисков.
37. Валютный риск.
38. Кредитный риск.
39. Производные финансовые инструменты.
40. Основные стратегии применения производных финансовых инструментов.
41. Риск выбора банка.
42. Риски опасностей.
43. Экологические и природные риски.
44. Криминальные риски и риск преступлений.
45. Судебные, бухгалтерские и налоговые риски.
46. Риски применения ошибочных схем налоговой оптимизации.
47. Риски регрессивного и прогрессивного состояния систем управления.
48. Основные понятия теории стоимости управления.
49. Риски потери капитала и ресурса влияния.
50. Риски снижения рентабельности управления.
51. Риски снижения рентабельности управления.
52. Риски, связанные с человеческим фактором.
53. Риски конфликтов. Риски нелояльности и оппортунизма.
54. Риски некомпетентности и непрофессионализма. Риски саботажа.
55. Концепция интегрированного управления рисками фирмы.
56. Программа управления рисками и ее компоненты.
57. Мониторинг программы управления рисками.
58. Разработка ситуационных планов.
59. Организационная структура службы управления рисками.
60. Психологические аспекты управления рисками.

***Типовое практическое задание (для оценки умений, навыков и (или) опыта деятельности):***

1. Построение риск-профиля организаций, функционирующих в различных секторах экономики

2. Задание: выявить риски, характерные для организаций, функционирующих в различных отраслях экономики, факторы риска. Построить риск-профили для этих организаций.

**Описание процедуры проведения промежуточной аттестации**

Экзамен проводится в форме собеседования по перечню теоретических вопросов и решения типовых контрольных заданий. Перечень теоретических вопросов, типовых контрольных заданий обучающиеся получают в начале семестра. При определении уровня достижений обучающегося на экзамене учитывается:

- знание программного материла и структуры дисциплины;

- знания, умение выполнять предусмотренные программой задания;

- владение методологией дисциплины, умение применять теоретические знания при решении задач, обосновывать свои действия.

**Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины**

**Основная литература**

Печатные издания

1. Предпринимательство и предпринимательские риски: учеб. пособие / Е. А. Малышев, Т. Е. Малышева, Т. И. Кашурникова. - Чита: ЗабГУ, 2015. - 237 с.

Издания из ЭБС

1. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469401>
2. Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов / В. Е. Шкурко ; под научной редакцией А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 182 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-05843-7. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/473824

**Дополнительная литература**

Печатные издания

1. Финансовая среда предпринимательства: учеб. пособие / Виноходова Анна Федоровна, Дмитрик Елена Георгиевна. - Старый Оскол : ТНТ, 2009. - 288 с.

Издания из ЭБС

1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент: учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2021. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/469020
2. Основы риск-менеджмента / М. Кроуи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 390 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02578-1. — Текст: электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/468418

Базы данных, информационно-справочные и поисковые системы

Образовательные ресурсы:

https://e.lanbook.com/ Электронно-библиотечная система «Издательство «Лань».

https://www.biblio-online.ru/ Электронно-библиотечная система «Юрайт»

http://www.studentlibrary.ru/ Электронно-библиотечная система «Консультант студента»

http://www.trmost.com/ Электронно-библиотечная система «Троицкий мост»

Научные ресурсы:

 http://diss.rsl.ru/ Электронная библиотека диссертаций Российской государственной библиотеки.

https://elibrary.ru/ Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU

Преподаватель \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Галынис Кирилл Игоревич

подпись

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Баранова Ольга Александровна

подпись