

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Силин Яков Петрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 08.06.2026 12:50:10
Уникальный программный идентификатор:
24f866be2aca16484036a8cbb3c509a9531e605f

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФГБОУ ВО «Уральский государственный экономический университет»

Выбрана
на заседании кафедры

24.11.2025 г.
протокол № 5
Зав. кафедрой Юзвович Л.И.

Утверждена
Советом по учебно-методическим
вопросам и качеству образования

16 декабря 2025 г.

протокол № 4

Председатель Карх Д.А.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование дисциплины	Теория риска и моделирование рисков ситуаций
Направление подготовки	38.04.04 Государственное и муниципальное управление
Профиль	Стратегическое планирование в сфере государственного и муниципального управления
Форма обучения	очно-заочная
Год набора	2026

Разработана:
Доцент, к.э.н.
Львова М.И.

Екатеринбург
2025 г.

СОДЕРЖАНИЕ

ВВЕДЕНИЕ	3
1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	3
2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	3
3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ	3
4. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ОПОП	3
5. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН	6
6. ФОРМЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ШКАЛЫ ОЦЕНИВАНИЯ	6
7. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	8
8. ОСОБЕННОСТИ ОРГАНИЗАЦИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ	12
9. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	12
10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ЛИЦЕНЗИОННОГО ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ОНЛАЙН КУРСОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ	13
11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ	14

ВВЕДЕНИЕ

Рабочая программа дисциплины является частью основной профессиональной образовательной программы высшего образования - программы магистратуры, разработанной в соответствии с ФГОС ВО

ФГОС ВО	Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.04 Государственное и муниципальное управление (приказ Минобрнауки России от 13.08.2020 г. № 1000)
---------	---

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

является получение системных, структурированных базовых знаний по основам теории риска и отработка практических навыков в системе управления рисками, а также управлению в условиях кризисной ситуации общей деятельностью в государственном и муниципальном управлении на разных фазах реализации.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений.

3. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Промежуточная аттестация	Часов					З.е.
	Всего за семестр	Контактная работа (по уч.зан.)			Самостоятельная работа в том числе подготовка контрольных и курсовых	
		Всего	Лекции	Практические занятия, включая курсовое проектирование		
Семестр 3						
Зачет с оценкой	144	16	4	12	128	4

4. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ОПОП

В результате освоения ОПОП у выпускника должны быть сформированы компетенции, установленные в соответствии ФГОС ВО.

Шифр и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
проектный	

<p>ПК-1 Обеспечение общеорганизационной подготовки проекта государственно-частного партнерства</p>	<p>ИД-1.ПК-1 Знать: систему правового регулирования и управления проектной деятельностью в сфере государственного управления; процедуры проектной деятельности, включая управление региональными, ведомственными проектами, управление портфелями проектов и программ, администрирования проектной деятельности исполнительных органов государственной власти; основные направления политики государства в сфере стратегического планирования; методы стратегического планирования и прогнозирования; систему развития и стандартизации проектного управления в государственном секторе; особенности формирования и развития системы проектной деятельности в органах власти и организациях; программы, концепции, стратегии развития отдельных сфер экономики; принципы проектного финансирования и государственно-частного партнерства.</p> <p>Методики, используемые в проектном управлении для определения целей и постановки задач. Основные механизмы финансирования проектов государственно-частного партнерства. Инструменты проектного финансирования. Системный анализ, теорию принятия решений. Методы и модели управления проектами. Методические рекомендации по оценке эффективности инвестиционных проектов. Особенности и практика применения механизмов государственно-частного партнерства на российском и зарубежном рынках.</p> <p>Методические документы по государственно-частному партнерству. Требования законодательства Российской Федерации и нормативных правовых актов, регулирующих деятельность в сфере государственно-частного партнерства. Бюджетное, налоговое, градостроительное и земельное законодательство Российской Федерации, регулирующие отношения, возникающие при реализации проекта государственно-частного партнерства. Организационно-правовые формы государственно-частного партнерства. Теорию управления рисками. Управление персоналом. Подходы к определению целевых показателей качества и эффективности проекта государственно-частного партнерства. Основы разработки концепции проекта государственно-частного партнерства, паспорта (устава) проекта государственно-частного партнерства. Правила проведения планирования деятельности по проекту государственно-частного партнерства на всех этапах жизненного цикла проекта, разработки иерархической структуры работ проекта государственно-частного партнерства. Описание детального распределения ролей и полномочий между лицами, задействованными в подготовке проекта государственно-частного партнерства, и определение соответствующих взаимосвязей между ними.</p>
--	---

<p>ПК-1 Обеспечение общеорганизационной подготовки проекта государственно-частного партнерства</p>	<p>ИД-2.ПК-1 Уметь: разрабатывать предварительную схему распределения прав и обязанностей между потенциальными участниками проекта, матрицы рисков проекта и перечня мероприятий по управлению рисками проекта государственно-частного партнерства. составлять штатную структуру проекта государственно-частного партнерства; планировать потребности проекта государственно-частного партнерства в специалистах; обеспечивать проведение консультаций с инвесторами, консультантами и иными участниками проекта государственно-частного партнерства; разрабатывать документы, отчетов по проекту государственно-частного партнерства, составлять прогноз хода выполнения работ по проекту государственно-частного партнерства; проводить коммуникации по проекту государственно-частного партнерств; выбирать и применять соответствующие инструменты и методы стратегического планирования и проектирования.</p>
	<p>ИД-3.ПК-1 Иметь практический опыт систематизации большого объема разнообразной информации, анализа, систематизации сведений и данных, документирования требований к процессам организации, их ресурсному обеспечению; формулирования задачи проекта государственно-частного партнерства, подготовки инвестиционного (информационный) меморандума по проекту государственно-частного партнерства; составления планов работ по проекту государственно-частного партнерства, разработки структуры и содержания организационных документов в рамках проекта государственно-частного партнерства; организации групповой работы, коммуникаций в рамках проекта государственно-частного партнерства, проведения переговоров с потенциальными интересантами проекта государственно-частного партнерства на всех стадиях жизненного цикла, в том числе с контрольно-надзорными органами; применения программного обеспечения (текстовые, графические, табличные и аналитических приложений, приложений для визуального представления данных) для работы с информацией; использования основных прикладных программных средств и информационных технологий, применяемых в сфере управления проектами.</p>
<p>организационно-управленческий</p>	
<p>ПК-2 Способность к организации и координированию процессов стратегического планирования в сфере реализации бюджетной политики</p>	<p>ИД-1.ПК-2 Знать: бюджетное и налоговое законодательство; организацию, особенности функционирования, структуру бюджетной системы Российской Федерации; основы бюджетного процесса и межбюджетных отношений в Российской Федерации; правовое регулирование бюджетного процесса на муниципальном уровне; основные направления бюджетной политики на текущий год и плановый период; основные направления и приоритеты в области долгосрочной бюджетной политики.</p>

ПК-2 Способность к организации и координированию процессов стратегического планирования в сфере реализации бюджетной политики	ИД-2.ПК-2 Уметь: готовить программы проведения контрольных и экспертно-аналитических мероприятий; работать с государственной интегрированной информационной системой управления общественными финансами "Электронный бюджет", в т.ч. ее подсистемой "Бюджетное планирование"; проводить оценку эффективности государственных программ Российской Федерации, федеральных целевых программ и ведомственных целевых программ; осуществлять математический анализ оценки изменения параметров бюджетов субъектов Российской Федерации и муниципальных образований; применять методы бюджетного регулирования, планирования.
	ИД-3.ПК-2 Иметь практический опыт использования федеральных государственных информационных систем, необходимых для осуществления внешнего государственного аудита (контроля).

5. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН

Тема	Наименование темы	Всего часов	Контактная работа (по уч.зан.)			Самост. работа	Контроль самостоятельной работы
			Лекции	Лабораторные	Практические занятия		
Семестр 3		22					
Тема 1.	Концептуальные основы социального конструирования риска (ПК-1, ПК-2)	22	1		1	20	
Семестр 3		23					
Тема 2.	Условия неопределенности и риска при разработке решений (ПК-1, ПК-2)	23	1		2	20	
Семестр 3		24					
Тема 3.	Система управления риском в организации (ПК-1, ПК-2)	24	1		2	21	
Семестр 3		23					
Тема 4.	Методы управления рисками (ПК-1, ПК-2)	23			2	21	
Семестр 3		26					
Тема 5.	Программа управления риском в организации (ПК-1, ПК-2)	26	1		3	22	
Семестр 3		26					
Тема 6.	Международные стандарты управления рисками (ПК-1, ПК-2)	26			2	24	

6. ФОРМЫ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ШКАЛЫ ОЦЕНИВАНИЯ

Раздел/Тема	Вид оценочного средства	Описание оценочного средства	Критерии оценивания
Текущий контроль (Приложение 4)			

Тема 1-6	Тестирование	5 закрытых вопросов, по 4 варианта ответа в каждом	1 балл за 1 правильный ответ
Тема 1-6	Опрос по конкретным темам курса	Темы для опроса	Оценивается 50-100%
Тема 6	Практическое задание	Решение ситуационной задачи	Оценивается 50-100%
Промежуточная аттестация (Приложение 5)			
3 семестр (ЗаО)	Билеты к зачету с оценкой	Два теоретических вопроса	Оценивается 50-100%

ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ

Показатель оценки освоения ОПОП формируется на основе объединения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающегося.

Показатель рейтинга по каждой дисциплине выражается в процентах, который показывает уровень подготовки студента.

Текущий контроль. Используется 100-балльная система оценивания. Оценка работы студента в течении семестра осуществляется преподавателем в соответствии с разработанной им системой оценки учебных достижений в процессе обучения по данной дисциплине.

В рабочих программах дисциплин и практик закреплены виды текущего контроля, планируемые результаты контрольных мероприятий и критерии оценки учебных достижений.

В течение семестра преподавателем проводится не менее 3-х контрольных мероприятий, по оценке деятельности студента. Если посещения занятий по дисциплине включены в рейтинг, то данный показатель составляет не более 20% от максимального количества баллов по дисциплине.

Промежуточная аттестация. Используется 5-балльная система оценивания. Оценка работы студента по окончанию дисциплины (части дисциплины) осуществляется преподавателем в соответствии с разработанной им системой оценки достижений студента в процессе обучения по данной дисциплине. Промежуточная аттестация также проводится по окончанию формирования компетенций.

Порядок перевода рейтинга, предусмотренных системой оценивания, по дисциплине, в пятибалльную систему.

Высокий уровень – 100% - 70% - отлично, хорошо.

Средний уровень – 69% - 50% - удовлетворительно.

Показатель оценки	По 5-балльной системе	Характеристика показателя
100% - 85%	отлично	обладают теоретическими знаниями в полном объеме, понимают, самостоятельно умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов на высоком уровне
84% - 70%	хорошо	обладают теоретическими знаниями в полном объеме, понимают, самостоятельно умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов. Могут быть допущены недочеты, исправленные студентом самостоятельно в процессе работы (ответа и т.д.)
69% - 50%	удовлетворительно	обладают общими теоретическими знаниями, умеют применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов на среднем уровне. Допускаются ошибки, которые студент затрудняется исправить самостоятельно.
49 % и менее	неудовлетворительно	обладают не полным объемом общих теоретическими знаниями, не умеют самостоятельно применять, исследовать, идентифицировать, анализировать, систематизировать, распределять по категориям, рассчитать показатели, классифицировать, разрабатывать модели, алгоритмизировать, управлять, организовать, планировать процессы исследования, осуществлять оценку результатов. Не сформированы умения и навыки для решения профессиональных задач
100% - 50%	зачтено	характеристика показателя соответствует «отлично», «хорошо», «удовлетворительно»
49 % и менее	не зачтено	характеристика показателя соответствует «неудовлетворительно»

7. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

7.1. Содержание лекций

Тема 1. Концептуальные основы социального конструирования риска (ПК-1, ПК-2)
Концепция риска в современной социологии. Эволюция понятия «риск»: риск естественный, цивилизационный, глобальный. Риск и неопределенность: различие понятий. Объективное и субъективное понимание риска. Структурные характеристики риска. Классификация рисков. От индустриального общества в общество риска (У. Бек). Производство и распределение рисков. Латентность рисков. Глобализация рисков. Риск на уровне социальных систем (Э.Гидденс). Доверие, риск и социальное действие. Риск и рациональность (Н. Луман). Компактизация риска (Дж. Ритцер). Концепция риска в социально-управленческом анализе. Восприятие риска. Формальная модель анализа риска. Компоненты процесса генерации риска. Модель анализа риска.

Тема 2. Условия неопределенности и риска при разработке решений (ПК-1, ПК-2)
Риск и его разновидности. Объективная и субъективная природа риска. Структурные характеристики риска. Альтернативность, противоречивость, неопределенность. Причины неопределенности. Характеристики ситуации неопределенности. Информационная структура решений в экстремальных ситуациях.

Тема 3. Система управления риском в организации (ПК-1, ПК-2)
Определение риск-менеджмента (управления риском). Развитие концепции управления риском. Свойства системы управления риском. Основные принципы управления рисками. Управление рисками как часть общего менеджмента. Управление риском и стратегия развития организации. Цели и задачи системы управления риском. Ограничения системы. Управление риском как динамический процесс.
Теория полезности и ее использование для поиска решений в условиях неопределенности и риска. Критерии оценки решения. Применение механизма интуиции для разработки решений. Психология поведения руководителей в ситуациях риска

Тема 5. Программа управления риском в организации (ПК-1, ПК-2)
Структура программы управления рисками. Процедуры разработки, контроля и пересмотра программы УР. Последовательность применения процедур управления рисками. Возможные варианты принципов управления, обусловленные процедурами управления рисками. Формирование плана превентивных мероприятий. Задачи и функциональные обязанности менеджера по управлению рисками.

7.2 Содержание практических занятий и лабораторных работ

Тема 2. Условия неопределенности и риска при разработке решений (ПК-1, ПК-2)
Семинарское занятие. Условия неопределенности и риска при разработке решений
Вопросы:
1. Природа риска. Структурные характеристики риска.
2. Причины неопределенности.
3. Информационная структура решений в экстремальных ситуациях.

Тема 3. Система управления риском в организации (ПК-1, ПК-2)

Семинарское занятие. Система управления риском в организации

Вопросы:

1. Управление рисками как часть общего менеджмента.
2. Управление риском и стратегия развития организации.
3. Свойства системы управления риском.
4. Критерии оценки решения.

Тема 4. Методы управления рисками (ПК-1, ПК-2)

План:

1. Принципы информационного обеспечения системы управления риском.
2. Основные принципы оценки риска: концепция приемлемого риска, пороговые значения риска, рисковый капитал.
3. Методы управления рисками: методы трансформации рисков, методы финансирования рисков.
4. Измерение риска: инженерный и модельный подходы.

Семинарское занятие. Методы управления рисками

Вопросы:

1. Принципы визуализации рисков.
2. Основные принципы оценки риска
3. Методы управления рисками
4. Измерение риска: инженерный и модельный подходы

Тема 5. Программа управления риском в организации (ПК-1, ПК-2)

Семинарское занятие. Программа управления риском в организации

Вопросы:

1. Процедуры разработки, контроля и пересмотра программы УР.
2. Задачи и функциональные обязанности менеджера по управлению рисками.

Тема 6. Международные стандарты управления рисками (ПК-1, ПК-2)

Семинарское занятие. Международные стандарты управления рисками

Вопросы:

1. Институциональная основа оценки риска и управления рисками.
2. Международные стандарты управления рисками.
3. Зарубежный опыт по установлению предельных уровней риска.

7.3. Содержание самостоятельной работы

Тема 2. Условия неопределенности и риска при разработке решений (ПК-1, ПК-2)

Характеристики ситуации неопределенности. Информационная структура решений в экстремальных ситуациях.

<p>Тема 3. Система управления риском в организации (ПК-1, ПК-2) Цели и задачи системы управления риском. Ограничения системы. Управление риском как динамический процесс. Теория полезности и ее использование для поиска решений в условиях неопределенности и риска. Критерии оценки решения. Применение механизма интуиции для разработки решений. Психология поведения руководителей в ситуациях риска</p>
<p>Тема 4. Методы управления рисками (ПК-1, ПК-2) Методы управления рисками: методы трансформации рисков, методы финансирования рисков. Измерение риска: инженерный подход. Модельный подход. Восприятие риска: ранжирование. Сопоставление разных способов измерения риска. Установление стандартов</p>
<p>Тема 5. Программа управления риском в организации (ПК-1, ПК-2) Последовательность применения процедур управления рисками. Возможные варианты принципов управления, обусловленные процедурами управления рисками. Формирование плана превентивных мероприятий. Задачи и функциональные обязанности менеджера по управлению рисками.</p>
<p>Тема 6. Международные стандарты управления рисками (ПК-1, ПК-2) Институциональная основа оценки риска и управления рисками: рекомендации на основе примеров различных стран ЕС. Международные стандарты управления рисками. Зарубежный опыт по установлению предельных уровней риска.</p>

7.3.1. Примерные вопросы для самостоятельной подготовки к зачету/экзамену
Приложение 1

7.3.2. Практические задания по дисциплине для самостоятельной подготовки к зачету/экзамену
Приложение 2

7.3.3. Перечень курсовых работ
Учебным планом не предусмотрено

7.4. Электронное портфолио обучающегося
Материалы не размещаются

7.5. Методические рекомендации по выполнению контрольной работы
Учебным планом не предусмотрено

7.6 Методические рекомендации по выполнению курсовой работы
Не предусмотрено

8. ОСОБЕННОСТИ ОРГАНИЗАЦИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

По заявлению студента

В целях доступности освоения программы для лиц с ограниченными возможностями здоровья при необходимости кафедра обеспечивает следующие условия:

- особый порядок освоения дисциплины, с учетом состояния их здоровья;
- электронные образовательные ресурсы по дисциплине в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья;
- изучение дисциплины по индивидуальному учебному плану (вне зависимости от формы обучения);
- электронное обучение и дистанционные образовательные технологии, которые предусматривают возможности приема-передачи информации в доступных для них формах.
- доступ (удаленный доступ), к современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам, состав которых определен РПД.

9. ПЕРЕЧЕНЬ ОСНОВНОЙ И ДОПОЛНИТЕЛЬНОЙ УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Сайт библиотеки УрГЭУ

<http://lib.usue.ru/>

Основная литература:

2. Воронцовский А. В. Оценка рисков [Электронный ресурс]: учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2025. - 179 – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/562370>

3. Чертыковцев В. К. Математическая теория рисков. Анализ рисков в социально-экономической сфере [Электронный ресурс]: учебник для вузов. - Москва: Юрайт, 2025. - 102 – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/558358>

4. Белов П. Г. Системный анализ и программно-целевой менеджмент рисков [Электронный ресурс]: учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2025. - 289 – Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/563680>

Дополнительная литература:

2. Шапкин А.С., Шапкин В.А. Теория риска и моделирование рисков ситуаций [Электронный ресурс]: Учебник. - Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2023. - 874 – Режим доступа: <https://znanium.com/catalog/product/2041752>

3. Львова Теория риска и моделирование рисков ситуаций. Тесты. Тест 1. Теоретические основы изучения риска как объекта исследования [Электронный ресурс]:. - Екатеринбург: [б. и.], 2025. - 5 – Режим доступа: <https://libw.usue.ru/202503/13.docx>

4. Львова Теория риска и моделирование рисков ситуаций. Тесты. Тест 2. Условия неопределенности и риска при разработке решений [Электронный ресурс]:. - Екатеринбург: [б. и.], 2025. - 5 – Режим доступа: <https://libw.usue.ru/202503/14.docx>

5. Львова Теория риска и моделирование рисков ситуаций. Тесты. Тест 3. Методы идентификации и управления рисками [Электронный ресурс]:. - Екатеринбург: [б. и.], 2025. - 5 – Режим доступа: <https://libw.usue.ru/202503/15.docx>

6. Львова Теория риска и моделирование рисковых ситуаций. Курс лекций. Тема 1. Теоретические основы изучения риска как объекта исследования [Электронный ресурс]:. - Екатеринбург: [б. и.], 2025. - 1 – Режим доступа: <https://libw.usue.ru/2x25-04/49.mp4>

7. Львова Теория риска и моделирование рисковых ситуаций. Курс лекций. Тема 2. Условия неопределенности и риска при разработке решений [Электронный ресурс]:. - Екатеринбург: [б. и.], 2025. - 1 – Режим доступа: <https://libw.usue.ru/2x25-04/52.mp4>

8. Львова Теория риска и моделирование рисковых ситуаций. Курс лекций. Тема 3. Методы идентификации и управления рисками [Электронный ресурс]:. - Екатеринбург: [б. и.], 2025. - 1 – Режим доступа: <https://libw.usue.ru/2x25-04/55.mp4>

10. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ЛИЦЕНЗИОННОГО ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ, ОНЛАЙН КУРСОВ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Перечень лицензионного программного обеспечения:

Microsoft Windows 10 .Договор № 52/223-ПО/2020 от 13.04.2020, Акт № Tr000523459 от 14.10.2020. Срок действия лицензии -Без ограничения срока.

Astra Linux Common Edition. Договор №0417-ПО/2019 от 08.05.2019, Акт №Sk000343 от 24.05.2019 и Контракт № 35-У/2018 от 13.06.2018, Акт № УТ213 от 17.12.2018. Срок действия лицензии - без ограничения срока.

Microsoft Office 2016.Договор № 52/223-ПО/2020 от 13.04.2020, Акт № Tr000523459 от 14.10.2020 Срок действия лицензии -Без ограничения срока.

МойОфис стандартный. Соглашение № СК-281 от 7 июня 2017. Дата заключения - 07.06.2017. Срок действия лицензии - без ограничения срока.

Перечень информационных справочных систем, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

Справочно-правовая система Гарант. Договор № 58419 от 22 декабря 2015. Срок действия лицензии -без ограничения срока

Справочно-правовая система Консультант +. Договор № 143/223-У/2025 от 02.12.2025 Срок действия лицензии до 31.12.2026

11. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Реализация учебной дисциплины осуществляется с использованием материально-технической базы УрГЭУ, обеспечивающей проведение всех видов учебных занятий и научно-исследовательской и самостоятельной работы обучающихся:

Специальные помещения представляют собой учебные аудитории для проведения всех видов занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду УрГЭУ.

Все помещения укомплектованы специализированной мебелью и оснащены мультимедийным оборудованием спецоборудованием (информационно-телекоммуникационным, иным компьютерным), доступом к информационно-поисковым, справочно-правовым системам, электронным библиотечным системам, базам данных действующего законодательства, иным информационным ресурсам служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Для проведения занятий лекционного типа презентации и другие учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации.

7.3.1. Примерные вопросы для самостоятельной подготовки к промежуточной аттестации

1. Причины возникновения экономических рисков.
2. Классификация экономических рисков.
3. Государственное регулирование рискованных ситуаций.
4. Роль инноваций в антикризисном управлении.
5. Антикризисная инвестиционная государственная политика.
6. Оптимизация кадровой политики в рискованной ситуации.
7. Правовая база государственного регулирования рискованной ситуации.
8. Технологические этапы политики управления рискованными ситуациями.
9. Процессные антикризисные преобразования.
10. Разработка стратегии управления риском.
11. Российское законодательство о несостоятельности (банкротстве).
12. Понятие, критерии и признаки несостоятельности.
13. Саморегулируемые организации арбитражного управляющего.
14. Права и обязанности арбитражного управляющего.
15. Ответственность арбитражного управляющего.
16. Досудебная санация и восстановительные мероприятия.
17. Понятие процедуры наблюдения и ее роль в системе процедур несостоятельности.
18. Финансовое оздоровление: общие положения.
19. План финансового оздоровления и график погашения задолженности.
20. Внешнее управление: общие положения.
21. Меры по восстановлению платежеспособности должника.
22. Понятие и сроки конкурсного производства.
23. Форма и содержание мирового соглашения.
24. Банкротство ликвидируемого должника.
25. Банкротство отсутствующего должника.

7.3.2. Практические задания по дисциплине для самостоятельной подготовки к экзамену/зачету

Примерные практические задания к экзамену/зачету

Упражнение 1.1. Финансовый аналитик должен обосновать включение в портфель дополнительной ценной бумаги, выбрав одну из двух ценных бумаг, историческая доходность которых за последние 5 лет представлена ниже.

Доходность акции А, % 14,75 7,23 15,66 18,45 12,14

Доходность акции В, % 20,33 10,85 5,22 22,41 19,23

Упражнение 1.2. Посоветуйте инвестору, какой из двух инвестиционных проектов выбрать: проект А с вероятностью 0,6 принесет прибыль 15 млн рублей, и с вероятностью 0,4 принесет убытки в размере 5,5 млн рублей. Проект В с вероятностью 0,8 принесет прибыль 10 млн рублей, а с вероятностью 0,2 – потери 6 млн рублей.

Упражнение 1.3. Предприниматель решает, в какой бизнес выгоднее вложиться: заняться бытовой техникой или выйти на рынок телекоммуникаций. При выборе первой альтернативы, при прочих равных условиях, через год случайный конечный доход реализуется с равными шансами в интервале от 37 тыс. у. е. до 73 тыс. у. е. При выборе второй альтернативы – в интервале от 40 тыс. у. е. до 69 тыс. у. е. Какой вид бизнеса выберет предприниматель?

Упражнение 1.4. Доход для первой альтернативы принимается как случайный конечный экономический результат, значения которого с равными шансами реализуются в интервале от 100 до 250 тыс. у. е., а для второй – от 95 до 220 тыс. у. е. Оцените и сравните риски.

Упражнение 1.5. Управляющий оперирует портфелем, содержащим 1 актив. Доход с актива обычно имеет распределение со средним значением 20% и стандартным отклонением 30%. Текущая цена портфеля составляет 100 млн долларов. Необходимо ответить на несколько простых вопросов, касающихся вероятностного распределения цены портфеля на конец года:

1. Каков характер этого распределения?
2. Какова вероятность понести убыток более 20 млн долларов к концу года (т. е. какова вероятность, что в конце года цена окажется ниже 80 млн)?
3. Какой максимальный убыток можно понести к концу года с вероятностью 1%.

№ задания	Правильный ответ	Содержание задания	Компетенция
1.		<p>Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска 2. прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска 3. умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности 4. умение ликвидировать такие последствия 	ПК-1,2
2.		<p>Содержательная сторона риск-менеджмента включает в себя:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. планирование деятельности по реализации рискованного проекта 2. сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска 3. выбор мер по минимизации или устранению последствий риска 4. организация службы управления рисками на предприятии 	ПК-1,2
3.		<p>Парадигма стоимости риска – это:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Value-at-Risk 2. Volume at Reduce 3. Volume at Resistance 4. Volume of Accepted Risk 	ПК-1,2
4.		<p>Что из перечисленного не является правилами риск-менеджмента</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. нельзя рисковать многим ради малого 2. риск – дело благородное 3. нельзя думать, что существует только одно решение, возможно, есть и другие 4. при существовании нескольких вариантов, следует идти по пути минимально риска 	ПК-1,2
5.		<p>Какие риски могут принести дополнительную прибыль фирме?</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. спекулятивные 2. чистые 3. ретроспективные 4. любые 	ПК-1,2
6.		<p>Интеграция, предполагающая объединение с конкурентами, – это:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. вертикальная регрессивная (обратная) интеграция 2. вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция 3. горизонтальная интеграция 4. круговая интеграция 	ПК-1,2
7.		<p>При использовании метода «Сокращение риска» покрытие убытка происходит за счет:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. нестрахового пула 	ПК-1,2

		<ul style="list-style-type: none"> 2. резервов 3. спонсора 4. государственной поддержки 	
8.		<p>Критерий пессимизма характеризуется выбором:</p> <ul style="list-style-type: none"> 1. лучшей альтернативы с худшим из всех худших значений окупаемости 2. худшей альтернативы с худшим из всех худших значений окупаемости 3. худшей альтернативы с лучшим из всех худших значений окупаемости 4. лучшей альтернативы с лучшим из всех лучших значений окупаемости 	ПК-1,2
9.		<p>Что из перечисленного не является функциями субъекта управления в риск- менеджменте?</p> <ul style="list-style-type: none"> 1. прогнозирование 2. нормирование 3. организация 4. регулирование 	ПК-1,2
10.		<p>Какие подходы выделяют при расчете VAR?</p> <ul style="list-style-type: none"> 1. эмпирический 2. логический 3. оценочный 4. ранжирование 	ПК-1,2
11.		все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка	ПК-1,2
12.		изменчивость рыночного спроса	ПК-1,2
13.		риск опережения роста доходов темпом их обесценивания	ПК-1,2
14.		При использовании метода «Передача риска» покрытие убытка происходит за счет:	ПК-1,2
15.		Примером покрытия ущерба за счет передачи ответственности на основе договора является:	ПК-1,2
16.		это страховая компания, входящая в состав нестраховых организаций	ПК-1,2
17.		Планируемые величины в ходе осуществления прогноза оцениваются понятием:	ПК-1,2
18.		Известный метод экспертных оценок для определения исходных данных перед стоящего моделирования инвестиционной программы носит название	ПК-1,2
19.		Метод оценки риска, используемый в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий	ПК-1,2
20.		_____ риски – такие риски, в результате которых реализации предприятию грозит потеря прибыли	ПК-1,2
21.		Вид риска, к которому относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент	ПК-1,2

22.		Риск того, что инновационный проект не будет реализован или окуплен	ПК-1,2
23.		Какой прогнозируемостью характеризуется наступления события (Pt) при полной определенности?	ПК-1,2
24.		Неопределенность, связанную с отсутствием информации о вероятностях состоянии среды (природы), называют	ПК-1,2
25.		Критерий гарантированного результата (максимальный критерий Вальда) является критерием	ПК-1,2
26.		Если событие не может произойти ни при каких условиях, его вероятность равна:	ПК-1,2
27.		Подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных техногенными катастрофами:	ПК-1,2
28.		Что является принципом действия механизма диверсификации риска	ПК-1,2
29.		Специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками	ПК-1,2
30.		Метод оценки риска, представляющий собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты	ПК-1,2
31.		В процессе принятия управленческих решений предпринимателю целесообразно различать и выделять определенные области (зоны риска) в зависимости от уровня возможных (ожидаемых) потерь. Для этого разработаны и используются шкала, которая носит название ?	ПК-1,2
32.		Какой метод оценки вероятностей используется в страховании?	ПК-1,2
33.		риск неоплаты задолженности дебитором	ПК-1,2
34.		Что определяет первая точка кривой риска	ПК-1,2
35.		Метод, используемый экспертами при оценке риска	ПК-1,2
36.		Финансирование под уступку денежного требования, подразумевающее передачу кредитного риска, это лежит в основе:	ПК-1,2
37.		Процесс снижения риска за счет увеличения разнообразия видов деятельности, рынков сбыта или каналов поставок носит название:	ПК-1,2
38.		К каким методам управления риском относится прогнозирование внешней обстановки?	ПК-1,2
39.		риск ухудшения конъюнктуры какого-либо рынка	ПК-1,2
40.		комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него	ПК-1,2