



**АВТОНОМНАЯ НЕКОММЕРЧЕСКАЯ ОРГАНИЗАЦИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«ИНСТИТУТ МЕЖДУНАРОДНЫХ ЭКОНОМИЧЕСКИХ СВЯЗЕЙ»**

**INSTITUTE OF INTERNATIONAL ECONOMIC RELATIONS**

Принята на заседании  
Учёного совета ИМЭС  
(протокол от 28 марта 2024 г. № 8)

**УТВЕРЖДАЮ**  
Ректор ИМЭС Ю.И. Богомолова  
28 марта 2024 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ  
АНАЛИЗ И ПРОГНОЗИРОВАНИЕ РЫНОЧНЫХ РИСКОВ**

по направлению подготовки  
38.03.05 Бизнес-информатика

Направленность (профиль)  
«Информационные технологии в бизнесе»

*Приложение 4*  
*к основной профессиональной образовательной программе*  
*по направлению подготовки 38.03.05 Бизнес-информатика,*  
*направленность (профиль) «Информационные технологии в бизнесе»*

Рабочая программа дисциплины «Анализ и прогнозирование рыночных рисков» входит в состав основной профессиональной образовательной программы высшего образования по направлению подготовки 38.03.05 Бизнес-информатика, направленность (профиль) «Информационные технологии в бизнесе» и предназначена для обучающихся очной и очно-заочной форм обучения.

## СОДЕРЖАНИЕ

1. Цель и задачи дисциплины .....	4
2. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы высшего образования.....	4
3. Объем дисциплины в зачетных единицах и академических часах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся.....	4
4. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения основной профессиональной образовательной программы.....	5
5. Содержание дисциплины.....	6
6. Структура дисциплины по темам с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий.....	8
7. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы и текущего контроля обучающихся по дисциплине .....	8
8. Перечень вопросов и типовые задания для подготовки к промежуточной аттестации ...	11
9. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины.....	13
10. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины и информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости).....	14
11. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины.....	15
12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине .....	17

## 1. Цель и задачи дисциплины

**Целью дисциплины** «Анализ и прогнозирование рыночных рисков» является формирование профессиональной культуры управления рисками, под которой понимается готовность и способность личности использовать в профессиональной деятельности приобретенную совокупность знаний, умений и навыков анализа и прогнозирования рисков, риск-ориентированного характера мышления и ценностных ориентаций, соответствующих инструментарию воздействия на риски и направленных на практическое применение стратегий снижения рисков и соответствующих им мер реагирования.

### **Задачи дисциплины:**

- приобретение понимания проблем устойчивого функционирования системы управления и снижения рисков, связанных с профессиональной деятельностью;
- овладение приемами рационализации профессиональной деятельности, ориентированными на снижение рыночного риска организации, портфеля активов, бизнеса;
- формирование профессиональной культуры управления рисками и риск-ориентированного мышления, при котором вопросы прогнозирования и планирования рисков и мер реагирования на риски рассматриваются в качестве важнейших приоритетов;
- развитие способностей идентификации и оценивания рисков в сфере своей профессиональной деятельности;
- готовности применения профессиональных знаний для минимизации негативных последствий от рисков, обеспечения и улучшения условий труда в сфере своей профессиональной деятельности;
- способностей к оценке вклада своей предметной области в решение проблем предупреждения и защиты от рыночных рисков, обоснования выбора ключевых мер их снижения.

## 2. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы высшего образования

Дисциплина «Анализ и прогнозирование рыночных рисков» входит в часть учебного плана, формируемую участниками образовательных отношений по направлению подготовки 38.03.05 Бизнес-информатика, направленность (профиль) «Информационные технологии в бизнесе».

## 3. Объем дисциплины в зачетных единицах и академических часах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы, всего – 108 часов.

Вид учебной работы	Всего часов	
	очная форма обучения	очно-заочная форма обучения
<b>Контактная работа с преподавателем (всего)</b>	<b>28</b>	<b>8</b>
В том числе:		
Занятия лекционного типа	14	6
Занятия семинарского типа (семинары)	14	2
<b>Самостоятельная работа (всего)</b>	<b>80</b>	<b>100</b>
Форма контроля	Зачет с оценкой	
<b>Общая трудоёмкость дисциплины</b>	<b>108</b>	

**4. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения основной профессиональной образовательной программы**

<b>Код и наименование (при наличии) компетенции</b>	<b>Код и наименование индикаторов достижения компетенции</b>	<b>Результаты обучения по дисциплине</b>
<p><b>ПК-1</b> Способен осуществлять сбор и анализ информации бизнес-анализа для принятия решений, выявлять и классифицировать риски и разрабатывать комплекс мероприятий по их минимизации</p>	<p><b>ИПК 1.1</b> Проводит сбор и анализ информации бизнес-анализа для принятия решений.</p> <p><b>ИПК 1.2</b> Выявляет и классифицирует риски и осуществляет разработку мероприятий по их снижению. Оценивает возможность и уровень их минимизации</p>	<p><b>Знать:</b> основы анализа и прогнозирования рыночных рисков.</p> <p><b>Уметь:</b> осуществлять расчеты и анализировать состав и экономическое содержание показателей риска, проводить классификацию рисков в зависимости от целей анализа.</p> <p><b>Владеть:</b> методами и инструментами анализа и прогнозирования рисков и разработкой на их основе комплекса мероприятий, в том числе, по их снижению.</p>

## 5. Содержание дисциплины

Наименование тем (разделов)	Содержание тем (разделов)
Тема 1. Риск как рыночная категория и теории рисков	Характерные особенности и среда риска. Понятия «риск» и «неопределенность». Отличительные особенности, природа и виды неопределённости. Характеристики и факторы риска. Риски – основные виды и структурные компоненты. Значение рисков в современном мире. Подходы к определению риска. Риск как экономическая категория. Значение компетенций в области управления риском для обеспечения устойчивого развития социума. Причины ошибочности решений. Основные теории рисков. Классическая теория. Неоклассическая теория. Школа риска Ф. Найта. Основные тенденции развития международной и российской практики управления рисками.
Тема 2. Методы оценки и анализа рисков и способы их выявления	Место и роль методов снижения рисков в предметной области и профессиональной деятельности. Определение контекста анализа рисков с целью выработки мероприятий по снижению и воздействию на риски. Структура и основные этапы оценивания рисков. Основы анализа риска. Рыночный анализ аспектов риска. Основные проблемы рисков. Стандарты риск-менеджмента. Сущность и виды рыночных рисков. Концепции и виды анализа. Распространенные модели оценки рисков. Сравнительный анализ различных методов оценки. Качественный анализ риска. Количественный анализ. Экспертные оценки. Дерево решений. Методы и инструменты идентификации рисков. Процесс определения риска. Направления идентификации. Алгоритм реализации.
Тема 3. Основы прогнозирования и моделирования рисков	Современная система показателей. Критерии и параметры. Предельно допустимые уровни и факторы риска – основные виды и принципы определения. Источники риска. Сценарии риска. Изменение динамики бизнес-рисков. Воздействие основных негативных факторов и их предельно допустимые уровни. Обеспечение системы устойчивого функционирования управления рисками. Определение и выбор соответствующих инструментов, методов и мер реагирования на риски. Анализ современных исследований. Основные принципы и этапы контроля и прогнозирования. Методы определения зон действия негативных факторов и их уровней. Принципы, методы и средства минимизации риска организации. Методы и инструменты анализа рисков. Методы и инструменты планирования реагирования на риски. Методы и инструменты контроля рисков. Новые методы и средства. Матрица рисков. Ключевые индикаторы рисков. Методики, виды и меры защиты и воздействия на риски. Основные этапы подготовки и проведения анализа рисков с целью принятия бизнес-решений. Порядок разработки комплекса мероприятий управления рисками. Анализ эффективности мер применения.
Тема 4. Современные инструменты и комплекс управления качеством риска	Анализ состава и экономического содержания показателей риска. Инструменты количественного анализа рисков. Поддержка и совершенствование культуры снижения рисками в организации. Базовые факторы риск-менеджмента. Изменение подхода к управлению рисками. Agile-культура. Scrum-методики. Карты процессов.

Наименование тем (разделов)	Содержание тем (разделов)
	Особенности проведения мероприятий по предупреждению негативных последствий рисков. Роль современных информационных технологий в защите от рисков. Карта и реестр рисков. Разработка методической базы системы снижения рисков в организации.
Тема 5. Практическое применение стратегий и мер воздействия на риски	Взаимосвязь мер воздействия на риски со стратегиями проведения мероприятий по их снижению. Стратегии управления рисками. Определение и выбор соответствующих инструментов, методов и мер реагирования на риски. Контроль и мониторинг результативности внедрения системы управления рисками в организации. Основные пути и стратегии минимизации рисков. Порядок внесения предложений по изменению стратегии управления рисками. Отчетность и учет в сфере риска.

**6. Структура дисциплины по темам с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий**

**Очная форма обучения**

№ п/п	Наименование тем (разделов) дисциплины	Контактная работа, час.		Самостоятельная работа, час.	Всего, час.
		Занятия лекционного типа	Семинары		
1.	Риск как рыночная категория и теории рисков	2	2	16	20
2.	Методы оценки и анализа рисков и способы их выявления	4	4	16	24
3.	Основы прогнозирования и моделирования рисков	4	4	16	24
4.	Современные инструменты и комплекс управления качеством риска	2	2	16	20
5.	Практическое применение стратегий и мер воздействия на риски	2	2	16	20
<b>Итого:</b>		<b>14</b>	<b>14</b>	<b>80</b>	<b>108</b>

**Очно-заочная форма обучения**

№ п/п	Наименование тем (разделов) дисциплины	Контактная работа, час.		Самостоятельная работа, час.	Всего, час.
		Занятия лекционного типа	Семинары		
1.	Риск как рыночная категория и теории рисков	1	-	20	21
2.	Методы оценки и анализа рисков и способы их выявления	1	1	20	22
3.	Основы прогнозирования и моделирования рисков	2	-	20	22
4.	Современные инструменты и комплекс управления качеством риска	1	1	20	22
5.	Практическое применение стратегий и мер воздействия на риски	1	-	20	21
<b>Итого:</b>		<b>6</b>	<b>2</b>	<b>100</b>	<b>108</b>

**7. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы и текущего контроля обучающихся по дисциплине**

Самостоятельная работа является одним из основных видов учебной деятельности, составной частью учебного процесса и имеет своей целью: глубокое усвоение материала дисциплины, совершенствование и закрепление навыков самостоятельной работы с



литературой, рекомендованной преподавателем, умение найти нужный материал и самостоятельно его использовать, воспитание высокой творческой активности, инициативы, привычки к постоянному совершенствованию своих знаний, к целеустремленному научному поиску.

Контроль самостоятельной работы, является важной составляющей текущего контроля успеваемости, осуществляется преподавателем во время лекционных и практических (семинарских) занятий и обеспечивает оценивание хода освоения изучаемой дисциплины.

### **Вопросы для самостоятельного изучения**

1. Информационное обеспечение процессов управления риском.
2. Технологические элементы процесса управления рисками.
3. Связь риска и доходности.
4. Факторы, определяющие уровень и влияющие на степень риска.
5. Виды спекулятивных рисков и специфические классификации по разным критериям.
6. Теории отечественных авторов о рыночном риске.
7. Теории зарубежных авторов о риске.
8. Общие вопросы моделирования.
9. Метод комиссии в системе анализа рисков.
10. Метод суда в системе анализа рисков.
11. Популярные модели оценки рисков: границы и особенности практического применения.
12. Метод анализа первичных причин и ущерба в системе анализа рисков.
13. Метод портфолио в системе анализа рисков.
14. Расчетно-аналитические методы оценки рисков ситуаций.
15. Методы, снижающие вероятность проявления риска.
16. Зарубежные методологии прогнозирования банкротства.
17. Отечественные методологии прогнозирования банкротства.
18. Развитие и применение основных методик анализа риска в современных условиях.
19. Основные направления снижения риска.
20. Стратегия управления инцидентами как средство минимизации рисков.
21. Стратегия прогнозирования как средство минимизации рисков.
22. Стратегия проактивного управления как средство минимизации рисков.

### **Примерные темы рефератов (докладов)**

1. Ключевые тенденции развития международной и российской практики анализа рисков.
2. Нейроэкономические теории рисков.
3. Модели оценки совокупного риска.
4. Теория управления риском Ларри Хайта.
5. Программные продукты для моделирования риска.
6. Риски в глобальной экономике: основные подходы к управлению.
7. Новые средства и инструменты анализа и прогнозирования рыночных рисков.
8. Инструментальные средства и программы моделирования рыночных рисков.
9. Риски мировой валютной системы. Перспективы кризиса.
10. Роль риск-менеджмента в системе управления рыночным риском организации.
11. Сравнение фрагментарного и комплексного подходов в управлении рисками.
12. Функция неприятия риска и ее связь с платой за риск.

13. Влияние учетной ставки процента на экономическую активность.
14. Процентные риски в системе рыночных рисков.
15. Международные и национальные стандарты минимизации рисков.
16. Информационно-аналитическая поддержка стратегий защиты от рыночных рисков.
17. Современный инструментарий нейтрализации рыночных рисков.
18. Современные методы оценки и инструменты регулирования рыночных рисков.
19. Майрон Шоулз и его методы управления рисками.
20. Определение, история развития и сферы применения методики VaR.
21. Джордж Сорос и финансовые риски в его деятельности.
22. Бейнард Мейдофф: история финансовой пирамиды и ее риски.
23. Метод Хаустона. Алгоритм сравнительной оценки эффективности.
24. Метод анализа (оценки) воздействия на бизнес.
25. Картографирование риска с использованием методологии Scrum.
26. Agile-культура минимизации рыночных рисков в организации.
27. Анализ и прогнозирование рисков на языке R.
28. Структурированный анализ сценариев.
29. Метод исследования опасности и функциональности.
30. Рынок форвардов в России. Хеджирование на основе инструментов FORTS.
31. Построение эффективных портфелей для рынка с двумя и тремя рисковыми активами.
32. Особенности отраслевого управления рыночными рисками.
33. Организация менеджмента рыночных рисков.
34. Основные организационные формы снижения рисков.
35. Порядок рейтинговая рисков по степени и уровням опасности.

### Распределение самостоятельной работы

Виды, формы и объемы самостоятельной работы студентов при изучении данной дисциплины определяются ее содержанием и отражены в следующей таблице:

№ п/п	Наименование тем (разделов) дисциплины	Вид самостоятельной работы	Объем самостоятельной работы	
			очная форма обучения	очно-заочная форма обучения
1.	Риск как рыночная категория и теории рисков	подготовка к аудиторным занятиям, написание рефератов, подготовка докладов	16	20
2.	Методы оценки и анализа рисков	подготовка к аудиторным занятиям, написание рефератов, подготовка докладов	16	20
3.	Основы прогнозирования и моделирования рисков	подготовка к аудиторным занятиям, написание рефератов, подготовка докладов	16	20

№ п/п	Наименование тем (разделов) дисциплины	Вид самостоятельной работы	Объем самостоятельной работы	
			очная форма обучения	очно-заочная форма обучения
4.	Современные инструменты и комплекс управления качеством риска	подготовка к аудиторным занятиям, написание рефератов, подготовка докладов	16	20
5.	Практическое применение стратегий и мер воздействия на риски	подготовка к аудиторным занятиям, написание рефератов, подготовка докладов	16	20
<b>ИТОГО:</b>			<b>80</b>	<b>100</b>

## 8. Перечень вопросов и типовые задания для подготовки к промежуточной аттестации

### 8.1 Перечень вопросов для подготовки к зачету с оценкой

1. Отличительные особенности, природа и виды неопределённости.
2. Риск как экономическая категория, основные компоненты и структура риска.
3. Основные этапы и теории развития рискованных отношений.
4. Сущность и виды рыночных рисков.
5. Основные этапы возникновения рисков.
6. Особенности и виды шкалы для измерения рисков.
7. Методы получения информации и выявления опасностей возникновения рисков.
8. Основные особенности оценки рыночных рисков.
9. Распространенные модели оценки рисков.
10. Сравнительный анализ основных методов анализа риска.
11. Качественные методы анализа и прогнозирования рисков.
12. Количественные методы анализа и прогнозирования рисков.
13. Экспертные методы оценки рисков.
14. Методы и инструменты анализа рисков.
15. Методы и инструменты планирования реагирования на риски.
16. Методы и инструменты контроля рисков.
17. Методики, виды и меры защиты и воздействия на риски.
18. Сравнение сильных и слабых сторон методов агрегирования рисков.
19. Основные этапы процесса определения риска.
20. Направления и алгоритм процесса идентификации.
21. Основные принципы и этапы контроля и прогнозирования.
22. Методы определения зон действия негативных факторов и их уровней.
23. Принципы, методы и средства минимизации риска организации.
24. Основные этапы подготовки и проведения анализа рисков с целью принятия бизнес-решений.
25. Порядок разработки комплекса мероприятий управления рисками.
26. Индикаторы и уровни принятия решений при оценке рисковости ситуации.
27. Матрица реагирования на риски и реестр рисков.
28. Стратегии управления рисками и ключевые индикаторы риска.
29. Контроль и мониторинг результативности внедрения системы управления рисками в организации.

30. Основные пути и стратегии минимизации рисков.
31. Порядок внесения предложений по изменению стратегии управления рисками.
32. Современная система показателей риска. Критерии и параметры выбора.
33. Отчетность и учет в сфере риска.
34. Особенности и схема проведения мониторинга рисков.
35. Анализ эффективности мер применения.

## 8.2. Типовые задания для оценки знаний

1. Анализ риска - это:
  - а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия;
  - б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты;
  - в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик;
  - г) заключительный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик.
  
2. Процесс эффективного использования механизмов снижения рисков называется:
  - а) диверсификация;
  - б) хеджирование;
  - в) лимитирование;
  - г) прогнозирование.
  
3. В рядах динамики для расчета среднего темпа роста применяется формула расчета средней:
  - а) геометрической;
  - б) арифметической;
  - в) степенной;
  - г) линейной.

## 8.3 Типовые задания для оценки умений

**Задание 1.** Заполните таблицу, разделив все перечисленные в перечне виды рисков на чистые и спекулятивные.

Таблица

Классификация рисков	
Чистые риски	Спекулятивные риски

Перечень рисков:

- 1) неуплата заемщиком процентов по кредиту;
- 2) кража запасов со склада организации;
- 3) валютные потери, связанных с изменением курса иностранной валюты по отношению к национальной валюте при проведении внешнеэкономических операций;
- 4) убыток от венчурного вложения капитала;
- 5) частичная потеря и порча товаров при транспортировке;
- 6) риск упущенной финансовой выгоды;
- 7) повреждение здания компании в результате землетрясения;
- 8) предъявление претензий со стороны третьих лиц за бракованный товар;

- 9) убыток по фьючерсному контракту;
- 10) издержки, понесенные организацией из-за приостановки производственного процесса в результате поломки оборудования;
- 11) невозвращение дебиторской задолженности в срок;
- 12) невозможность осуществления хозяйственной деятельности вследствие военных действий;
- 13) введение эмбарго из-за отказа нового правительства выполнять принятые предшественниками обязательства;
- 14) увеличение ставок действующих налоговых платежей;
- 15) возможность обесценения реальной стоимости капитала в связи с ростом инфляции;
- 16) закрытие рыбного хозяйства в связи с загрязнением окружающей среды;
- 17) изменение дивидендов по акциям для инвестора;
- 18) неполучение комиссионного вознаграждения для брокерской фирмы.

**Задание 2.** Сроки реализации инновационного проекта по плану - 5 лет. Срыв сроков реализации по расчетам специалистов может произойти по следующим причинам:

- 1) из-за несвоевременного финансирования - в 5-ти случаях из 20;
- 2) по вине поставщиков - в 10 случаях из 50;
- 3) по вине проектировщиков - в 2-х случаях из 100;

Требуется рассчитать вероятность рисков по каждой причине и общий рыночный риск.

#### **8.4 Типовые задания для оценки навыков**

**Задание 1.** Заполните реестр рыночного риска в таблице MS Excel. Оформите весь массив необходимых для его ведения данных. Рассчитайте степень подверженности риску, на основании чего предложите необходимое мероприятие по снижению риска. Аргументируйте свой выбор.

**Задание 2.** АО «Виктория» предстоит выбрать одно из двух альтернативных вложений временно свободных средств организации в размере 5 млн руб.:

- купить облигации федерального займа с гарантированной доходностью 11 % годовых;
- разместить средства в инвестиционно-финансовую организацию под 24 % годовых.

Риск вложений в государственные ценные бумаги составляет 1 %, а операций по размещению средств в микрофинансовых организациях – 10 %. Оцените степень риска, примите управленческое решение и обоснуйте его.

### **9. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины**

#### **9.1. Основная литература**

1. Анализ и прогнозирование рынка : учебник для вузов / А. Н. Асаул, М. А. Асаул, В. Н. Старинский, Г. Ф. Щербина ; под редакцией А. Н. Асаула. — 2-е изд., доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 296 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-15179-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/544477>

2. Белов, П. Г. Системный анализ и программно-целевой менеджмент рисков : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 289 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-04690-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/539784>

3. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/535956>

## 9.2. Дополнительная литература

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, 2024. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/536005>

2. Турчаева, И. Н. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски : учебник и практикум для вузов / И. Н. Турчаева, Я. Ю. Таенчук. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 215 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-15778-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/543567>

3. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 569 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13380-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/536964>

## 10. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины и информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

1. <http://biblioclub.ru> – ЭБС «Университетская библиотека онлайн»
2. <https://urait.ru> – ЭБС «Образовательная платформа Юрайт»
3. [https://elibrary.ru/org\\_titles.asp?orgsid=14364](https://elibrary.ru/org_titles.asp?orgsid=14364) – научная электронная библиотека (НЭБ) «eLIBRARY.RU»
4. <https://rosstat.gov.ru/> – Федеральная служба государственной статистики (Росстат).
5. <https://www.fedstat.ru/> – Сайт государственной статистики
6. <https://student2.consultant.ru/> – онлайн-версия КонсультантПлюс: Студент информационной справочной системы «КонсультантПлюс»
7. <https://cbr.ru/analytics/finstab/orfr/> – Обзор финансовых рисков Центрального Банка РФ
8. <https://www.exiar.ru/map/> – Электронная интерактивная карта экспортных рисков ЭКСАР
4. <http://economicus.ru> – экономический портал, где представлены работы и биографии известных экономистов, профессиональный каталог экономических ресурсов Интернет, экономическая конференция, учебно-методические материалы для преподающих и изучающих экономику, подборка словарей, энциклопедий, справочников по самым разнообразным областям экономики, наиболее полное собрание лекций по экономической теории.

### Лицензионное программное обеспечение:

- Windows (зарубежное, возмездное);
- MS Office (зарубежное, возмездное);

- Adobe Acrobat Reader (зарубежное, свободно распространяемое);
- КонсультантПлюс: «КонсультантПлюс: Студент» (российское, свободно распространяемое);
- 7-zip – архиватор (зарубежное, свободно распространяемое);
- Comodo Internet Security (зарубежное, свободно распространяемое).

## **11. Методические рекомендации по организации изучения дисциплины**

Организация образовательного процесса регламентируется учебным планом и расписанием учебных занятий. Язык обучения (преподавания) – русский.

При формировании своей индивидуальной образовательной траектории обучающийся имеет право на перезачет соответствующих дисциплин и профессиональных модулей, освоенных в процессе предшествующего обучения, который освобождает обучающегося от необходимости их повторного освоения.

### **Образовательные технологии**

Учебный процесс при преподавании курса основывается на использовании традиционных, инновационных и информационных образовательных технологий. Традиционные образовательные технологии представлены занятиями семинарского и лекционного типа. Инновационные образовательные технологии используются в виде широкого применения активных и интерактивных форм проведения занятий. Информационные образовательные технологии реализуются путем активизации самостоятельной работы студентов в информационной образовательной среде.

#### **Занятия лекционного типа**

Лекционный курс предполагает систематизированное изложение основных вопросов учебного плана.

На первой лекции лектор обязан предупредить студентов, применительно к какому базовому учебнику (учебникам, учебным пособиям) будет прочитан курс.

Лекционный курс должен давать наибольший объем информации и обеспечивать более глубокое понимание учебных вопросов при значительно меньшей затрате времени, чем это требуется большинству студентов на самостоятельное изучение материала.

#### **Занятия семинарского типа**

Семинары (практические занятия) представляют собой детализацию лекционного теоретического материала, проводятся в целях закрепления курса.

Основной формой проведения семинаров и практических занятий является обсуждение наиболее проблемных и сложных вопросов по отдельным темам, а также решение задач и разбор примеров и ситуаций в аудиторных условиях. В обязанности преподавателя входят: оказание методической помощи и консультирование студентов по соответствующим темам курса.

Активность на практических занятиях оценивается по следующим критериям:

- ответы на вопросы, предлагаемые преподавателем;
- участие в дискуссиях;
- выполнение проектных и иных заданий;
- ассистирование преподавателю в проведении занятий.

Доклады и оппонирование докладов проверяют степень владения теоретическим материалом, а также корректность и строгость рассуждений.

Оценивание практических заданий входит в накопленную оценку.

#### **Самостоятельная работа обучающихся**

Самостоятельная работа студентов – это процесс активного, целенаправленного приобретения студентом новых знаний, умений без непосредственного участия преподавателя, характеризующийся предметной направленностью, эффективным контролем и оценкой результатов деятельности обучающегося.

Цели самостоятельной работы:

- систематизация и закрепление полученных теоретических знаний и практических умений студентов;
- углубление и расширение теоретических знаний;
- формирование умений использовать нормативную и справочную документацию, специальную литературу;
- развитие познавательных способностей, активности студентов, ответственности и организованности;
- формирование самостоятельности мышления, творческой инициативы, способностей к саморазвитию, самосовершенствованию и самореализации;
- развитие исследовательских умений и академических навыков.

Самостоятельная работа может осуществляться индивидуально или группами студентов в зависимости от цели, объема, уровня сложности, конкретной тематики.

Технология организации самостоятельной работы студентов включает использование информационных и материально-технических ресурсов образовательного учреждения.

Перед выполнением обучающимися самостоятельной работы преподаватель может проводить инструктаж по выполнению задания. В инструктаж включается:

- цель и содержание задания;
- сроки выполнения;
- ориентировочный объем работы;
- основные требования к результатам работы и критерии оценки;
- возможные типичные ошибки при выполнении.

Инструктаж проводится преподавателем за счет объема времени, отведенного на изучение дисциплины.

Контроль результатов самостоятельной работы студентов может проходить в письменной, устной или смешанной форме.

Студенты должны подходить к самостоятельной работе как к наиболее важному средству закрепления и развития теоретических знаний, выработке единства взглядов на отдельные вопросы курса, приобретения определенных навыков и использования профессиональной литературы.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся должны быть оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду организации.

При самостоятельной проработке курса обучающиеся должны:

- просматривать основные определения и факты;
- повторить законспектированный на лекционном занятии материал и дополнить его с учетом рекомендованной по данной теме литературы;
- изучить рекомендованную литературу, составлять тезисы, аннотации и конспекты наиболее важных моментов;
- самостоятельно выполнять задания, аналогичные предлагаемым на занятиях;
- использовать для самопроверки материалы фонда оценочных средств;
- выполнять домашние задания по указанию преподавателя.

### **Рекомендации по обучению инвалидов и лиц с ОВЗ**

Освоение дисциплины инвалидами и лицами с ОВЗ может быть организовано как совместно с другими обучающимися, так и в отдельных группах. Предполагаются специальные условия для получения образования инвалидами и лицами с ОВЗ.

Профессорско-педагогический состав знакомится с психолого-физиологическими особенностями обучающихся инвалидов и лиц с ОВЗ, индивидуальными программами реабилитации инвалидов (при наличии). При необходимости осуществляется



дополнительная поддержка преподавания тьюторами, психологами, социальными работниками, прошедшими подготовку ассистентами.

В соответствии с методическими рекомендациями Минобрнауки РФ (утв. 8 апреля 2014 г. № АК-44/05вн) в курсе предполагается использовать социально-активные и рефлексивные методы обучения, технологии социокультурной реабилитации с целью оказания помощи в установлении полноценных межличностных отношений с другими студентами, создании комфортного психологического климата в студенческой группе. Подбор и разработка учебных материалов производятся с учетом предоставления материала в различных формах: аудиальной, визуальной, с использованием специальных технических средств и информационных систем.

Медиа материалы также следует использовать и адаптировать с учетом индивидуальных особенностей обучения инвалидов и лиц с ОВЗ.

Освоение дисциплины инвалидами и лицами с ОВЗ осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения (персонального и коллективного использования). Материально-техническое обеспечение предусматривает приспособление аудиторий к нуждам инвалидов и лиц с ОВЗ.

Форма проведения аттестации для студентов-инвалидов и лиц с ОВЗ устанавливается с учетом индивидуальных психофизических особенностей. Для инвалидов и лиц с ОВЗ предусматривается доступная форма предоставления заданий оценочных средств, а именно:

- в печатной или электронной форме (для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата);
- в печатной форме или электронной форме с увеличенным шрифтом и контрастностью (для лиц с нарушениями слуха, речи, зрения);
- методом чтения ассистентом задания вслух (для лиц с нарушениями зрения).

Студентам с инвалидностью и лицам с ОВЗ увеличивается время на подготовку ответов на контрольные вопросы. Для таких студентов предусматривается доступная форма предоставления ответов на задания, а именно:

- письменно на бумаге или набором ответов на компьютере (для лиц с нарушениями слуха, речи);
- выбором ответа из возможных вариантов с использованием услуг ассистента (для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата);
- устно (для лиц с нарушениями зрения, опорно-двигательного аппарата).

При необходимости для обучающихся с инвалидностью и лиц с ОВЗ процедура оценивания результатов обучения может проводиться в несколько этапов.

## **12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине**

**Учебная аудитория** «Кабинет безопасности жизнедеятельности», предназначенная для проведения учебных занятий, предусмотренных настоящей рабочей программой дисциплины, оснащенная оборудованием и техническими средствами обучения, в состав которых входят: комплекты специализированной учебной мебели, доска классная, учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации по дисциплине, шкаф с оборудованием, мультимедийный проектор, экран, компьютер с установленным лицензионным программным обеспечением, с выходом в сеть «Интернет» и доступом в электронную информационно-образовательную среду.

**Помещение для самостоятельной работы** обучающихся – аудитория, оснащенная следующим оборудованием и техническими средствами: специализированная мебель для преподавателя и обучающихся, доска учебная, мультимедийный проектор, экран, звуковые колонки, компьютер (ноутбук), персональные компьютеры для работы обучающихся с установленным лицензионным программным обеспечением, с выходом в сеть «Интернет» и доступом в электронную информационно-образовательную среду.