

МИНОБРНАУКИ РОССИИ  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
**«Тверской государственный технический университет»**  
(ТвГТУ)

УТВЕРЖДАЮ  
Проректор  
по учебной работе  
\_\_\_\_\_ Э.Ю. Майкова  
« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 2021г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

дисциплины части, формируемой участниками образовательных отношений  
Блока 1 «Дисциплины (модули)»  
**«Риск-менеджмент и экономическая безопасность фирмы»**

Направление подготовки магистров – 38.04.01 Экономика  
Направленность (профиль) – Экономика фирмы.  
Типы задач профессиональной деятельности: организационно-  
управленческий.

Форма обучения – очная и очно-заочная

Факультет управления и социальных коммуникаций  
Кафедра «Менеджмент»

Тверь 2021

Рабочая программа дисциплины соответствует ОХОП подготовки магистров в части требований к результатам обучения по дисциплине и учебному плану.

Разработчик программы: к.э.н., доц.

О.А. Белоусов

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры «Менеджмент»  
« \_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 2021г., протокол № \_\_\_\_.

Заведующий кафедрой

О.П. Разинькова

Согласовано  
Начальник учебно-методического  
отдела УМУ

Д.А. Барчуков

Начальник отдела  
комплектования  
зональной научной библиотеки

О.Ф. Жмыхова

## **1. Цели и задачи дисциплины**

**Целью** изучения дисциплины «Риск-менеджмент и экономическая безопасность фирмы» дать представление о современных подходах к построению системы риск-менеджмента на современных предприятиях (организациях), способствовать приобретению навыков в использовании методов управления рисками при решении практических задач

**Задачами дисциплины** являются:

- приобретение теоретической подготовки в области анализа методов управления рисками, классификации рисков разной природы;
- формирование умений по составлению программы управления риском; использованию различных мер риска в контексте экономических методик (применение дисперсий, вычисление рискового капитала, измерение экономической добавленной стоимости); учета риска при управлении бизнес-процессами; принимать решения в процессах, связанных с созданием эффективной системы риск-менеджмента и ее функционированием;
- овладение методом анализа различных экономических ситуаций с точки зрения управления риском.

## **2. Место дисциплины в образовательной программе**

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 «Дисциплины (модули)».

Освоение дисциплины опирается на теоретические знания, полученные магистрантом на предыдущем уровне высшего образования, а также дисциплин «Актуальные проблемы современного менеджмента», «Актуальные проблемы экономической науки и управления фирмой», «Методы планирования, анализа и контроля в экономике», «Планирование и управление производственными ресурсами предприятия» и др.

Приобретенные знания в рамках дисциплины необходимы для формирования наряду с другими изучаемыми дисциплинами целостного представления о направлении «Экономика», а также при написании магистерской диссертации.

## **3. Планируемые результаты обучения по дисциплине**

### **3.1. Планируемые результаты обучения по дисциплине**

#### **Компетенция, закрепленная за дисциплиной в ОХОП:**

ПК-6. Способен производить внутренний контроль соответствия содержания проекта завершающего документа рекомендациям и выводам по устранению выявленных отклонений и соблюдения формы, определенной внутренним стандартом экономического субъекта.

#### **Индикаторы компетенций, закрепленных за дисциплиной в ОХОП:**

ИПК-6.1. Производит внутренний контроль соответствия содержания проекта завершающего документа рекомендациям и выводам по устранению

выявленных отклонений и соблюдения формы, определенной внутренним стандартом экономического субъекта.

ИПК-6.2. Оценивает обоснованность замечаний руководителя объекта внутреннего контроля по поводу содержания, выводов и рекомендаций, изложенных в завершающем документе.

ИПК-6.3. Производит аналитические процедуры по оценке качества завершающих документов по результатам внутреннего контроля и по замечаниям руководителей с учетом рисков объектов внутреннего контроля по ключевым параметрам работы экономического субъекта.

#### **Показатели оценивания индикаторов достижения компетенций**

ИПК-6.1.

##### **Знать:**

З1.1. принципы проведения внутреннего контроля соответствия содержания проекта завершающего документа рекомендациям и выводам по устранению выявленных отклонений и соблюдения формы, определенной внутренним стандартом экономического субъекта

##### **Уметь:**

У1.1. использовать принципы проведения внутреннего контроля соответствия содержания проекта завершающего документа рекомендациям и выводам по устранению выявленных отклонений и соблюдения формы, определенной внутренним стандартом экономического субъекта

##### **Иметь опыт практической подготовки:**

ПП1.1. использования принципов проведения внутреннего контроля соответствия содержания проекта завершающего документа рекомендациям и выводам по устранению выявленных отклонений и соблюдения формы, определенной внутренним стандартом экономического субъекта

ИПК-6.2.

##### **Знать:**

З2.1. принципы оценки обоснованности замечаний руководителя объекта внутреннего контроля по поводу содержания, выводов и рекомендаций, изложенных в завершающем документе

##### **Уметь:**

У2.1. оценить обоснованность замечаний руководителя объекта внутреннего контроля по поводу содержания, выводов и рекомендаций, изложенных в завершающем документе

##### **Иметь опыт практической подготовки:**

ПП2.1. оценки обоснованности замечаний руководителя объекта внутреннего контроля по поводу содержания, выводов и рекомендаций, изложенных в завершающем документе

ИПК-6.3.

##### **Знать:**

33.1. принципы проведения аналитических процедур по оценке качества завершающих документов по результатам внутреннего контроля и по замечаниям руководителей с учетом рисков объектов внутреннего контроля по ключевым параметрам работы экономического субъекта

**Уметь:**

УЗ.1. применять принципы проведения аналитических процедур по оценке качества завершающих документов по результатам внутреннего контроля и по замечаниям руководителей с учетом рисков объектов внутреннего контроля по ключевым параметрам работы экономического субъекта

**Иметь опыт практической подготовки:**

ППЗ.1. применения принципов проведения аналитических процедур по оценке качества завершающих документов по результатам внутреннего контроля и по замечаниям руководителей с учетом рисков объектов внутреннего контроля по ключевым параметрам работы экономического субъекта

**3.2. Технологии, обеспечивающие формирования компетенций**

Проведение лекционных и практических работ.

**4. Трудоемкость дисциплины и виды учебной работы**

**ОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ**

Таблица 1а. Распределение трудоемкости дисциплины по видам учебной работы

Вид учебной работы	Зачетные единицы	Академические часы
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	2	72
<b>Аудиторные занятия, всего</b>		26
В том числе:		
Лекции		13
Практические занятия (ПЗ)		13
Лабораторный практикум (ЛР)		Не предусмотрен
<b>Самостоятельная работа обучающегося (всего)</b>		46
В том числе:		
Курсовой проект (КП)		Не предусмотрен
Курсовая работа (КР)		не предусмотрена
Другие виды самостоятельной работы: • подготовка к практическим работам и к их защите		20
Контроль текущий и промежуточный (балльно-рейтинговый, зачет)		26
<b>Практическая подготовка при реализации дисциплины (всего)</b>		<b>13</b>

Вид учебной работы	Зачетные единицы	Академические часы
Практические занятия (ПЗ)		13
Лабораторный практикум (ЛР)		Не предусмотрен
Курсовой проект (КП)		Не предусмотрен
Курсовая работа (КР)		не предусмотрена

### ОЧНО-ЗАОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 1б. Распределение трудоемкости дисциплины по видам учебной работы

Вид учебной работы	Зачетные единицы	Академические часы
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	3	72
<b>Аудиторные занятия, всего</b>		20
В том числе :		
Лекции		8
Практические занятия (ПЗ)		12
Лабораторный практикум (ЛР)		Не предусмотрен
<b>Самостоятельная работа обучающегося (всего)</b>		52
В том числе:		
Курсовой проект (КП)		Не предусмотрен
Курсовая работа (КР)		не предусмотрена
Другие виды самостоятельной работы: • подготовка к практическим работам и к их защите		30
Контроль текущий и промежуточный (балльно-рейтинговый, зачет)		22
<b>Практическая подготовка при реализации дисциплины (всего)</b>		12
Практические занятия (ПЗ)		12
Лабораторный практикум (ЛР)		Не предусмотрен
Курсовой проект (КП)		Не предусмотрен
Курсовая работа (КР)		не предусмотрена

## 5. Структура и содержание дисциплины

### 5.1. Структура дисциплины

#### ОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 2а. Модули дисциплины, трудоемкость в часах и виды учебной работы

Наименование модуля	Труд-ть	Лекции	Практич. занятия	Лаб. работы	Сам. работа
1. Основные понятия управления рисками. Эволюция развития риск-	7	1	1	—	5

Наименование модуля	Труд-ть	Лекции	Практич. занятия	Лаб. работы	Сам. работа
менеджмента					
2. Классические и современные теории рисков	7,5	1,5	1,5	—	4,5
3. Типы фирм с повышенной степенью риска	7	1	1	—	5
4. Методы управления рисками	7,5	1,5	1,5	—	4,5
5. Система управления рисками фирмы. Законодательные и нормативные акты	7	1	1	—	4,5
6. Особенности управления финансовыми операционными и бизнес рисками фирмы	7,5	1,5	1,5	—	4,5
7. Риски в маркетинге	7	1	1	—	4,5
8. Страхование предпринимательских рисков	7	1,5	1,5	—	4,5
9. Комплексный риск менеджмент	7	1,5	1,5	—	4,5
10. Измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы	7,5	1,5	1,5	—	4,5
Всего на дисциплину	72	13	13	—	46

### ОЧНО-ЗАОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 2б. Модули дисциплины, трудоемкость в часах и виды учебной работы

Наименование модуля	Труд-ть	Лекции	Практич. занятия	Лаб. работы	Сам. работа
1. Основные понятия управления рисками. Эволюция развития риск-менеджмента	7	0,5	1,5	—	5,5
2. Классические и современные теории рисков	7,5	1	1	—	5
3. Типы фирм с повышенной степенью риска	7	0,5	1,5	—	5,5

Наименование модуля	Труд-ть	Лекции	Практич. занятия	Лаб. работы	Сам. работа
4. Методы управления рисками	7,5	1	1	—	5
5. Система управления рисками фирмы. Законодательные и нормативные акты	7	0,5	1,5	—	5,5
6. Особенности управления финансовыми операционными и бизнес рисками фирмы	7,5	1	1	—	5
7. Риски в маркетинге	7	0,5	1,5	—	5,5
8. Страхование предпринимательских рисков	7	1	1	—	5
9. Комплексный риск менеджмент	7	1	1	—	5
10. Измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы	7,5	1	1	—	5
Всего на дисциплину	72	8	12	—	52

## 5.2. Содержание дисциплины

### **МОДУЛЬ 1 «Основные понятия управления рисками. Эволюция развития риск-менеджмента»**

Понятие и ситуация риска. Неопределенность и ситуация риска. Природа неопределённости. Классификации риска. Основные и второстепенные функции риск-менеджмента.

Эволюция риск-менеджмента. Цели комплексного риск-менеджмента.

Факторы, способствовавшие развитию риск-менеджмента как самостоятельной дисциплины и сферы деятельности.

### **МОДУЛЬ 2 «Классические и современные теории рисков»**

Классическая теория предпринимательского риска (Дж. Милль, Н. Сениор).

Основы неоклассической теории предпринимательского риска (А. Маршалл и А. Пигу). Кейсианская экономическая школа. Подход Ф. Найта.

Проблемы риска в отечественной экономической науке в теоретических работах А.П. Альгина, С.Н. Кошеленко, И.М. Сыроежина, Д.Н. Назарова,

Д.В. Тулина.

### **МОДУЛЬ 3 «Типы фирм с повышенной степенью риска»**

Понятие кримтипологии фирмы. Причины появления фирм с повышенной степенью риска. Типичные отличительные черты фирм с повышенной степенью риска.

Фирмы личных услуг. «Фирмы-зомби». «Жиро-фирмы»: аккумуляторы и операторы. «Псевдофирмы». Фирмы-конструктивы: основные виды. «Фантомные фирмы» и их специфика. Собственность партнерской фирмы.

#### **МОДУЛЬ 4 «Методы управления рисками»**

Две стороны риска: вероятность потерь и величина потерь.

Методы управления рисками: методы минимизации и возмещения потерь.

Количественные методы оценки рисков: метод аналогий, анализ вероятностных распределений потоков платежей, метод сценариев, метод корректировки нормы дисконта, метод ставки процента с оплатой за риск.

Принятие решений на основе математического ожидания и дисперсии. Дисперсия как мера риска. Показатели корреляции и ковариации.

Оценка по историческим данным, экспертный метод, натуральное моделирование. Метод многофакторного анализа риска.

Метод оценки стоимости риска — VaR (Value-at-Risk). Методология VaR.

Метод оценки рисков Stress Testing. Основные задачи и принципы стрессового тестирования. Подходы к организации стресс-тестирования в кредитных организациях (на основе обзора международной финансовой практики)

#### **МОДУЛЬ 5 «Система управления рисками фирмы. Законодательные и нормативные акты»**

Этапы управления рисками. Процесс управления рисками: целеполагание, маркетинг, менеджмент. Системный подход в управлении рисками. Классификация решений управления рисками.

Организация управления рисками. Снижение рисков: на этапе планирования операции или проектирования образцов; на этапе принятия решений, с использованием критериев оценки эффективности решения (критерии Вальда и Сэвиджа); на этапе выполнения операции и эксплуатации технических систем.

Риск-решения традиционного, системного, ситуационного, социально-этичного менеджмента. Типовые алгоритмы риск-решений. Алгоритм принятия решений при традиционном, системном и ситуационном риск-менеджменте комиссия и танъема.

Законодательные и нормативные акты, регламентирующие риски в управлении фирмой.

#### **МОДУЛЬ 6 «Особенности управления финансовыми операционными и бизнес рисками фирмы»**

Сущность, критерии и особенности финансовых рисков. Классификации финансовых рисков. Риск нарушения равновесия финансового развития.

Риск неплатежеспособности предприятия. Страхование риска потери прибыли. Основные элементы при расчете размеров ущерба: текущие расходы и упущенная прибыль.

Управление активами и пассивами в коммерческой структуре. Стратегия управления активами и пассивами. Содержание стратегии управления и ее взаимосвязь с устойчивостью банка. Организационная функция управления активами и пассивами.

Риск ликвидности. Факторы, влияющие на уровень риска ликвидности. Методы управления ликвидностью. Управление риском ликвидности: лимит текущей и перспективной ликвидности. Разрывы срочной структуры (лестница сроков). Достаточность капитала банков.

Внутренние риски: кредитные, процентные, валютные, рыночные риски и риски финансовых услуг. Внешние риски (международные, страновые, республиканские, региональные): страховые риски, риски стихийных бедствий, правовые (законодательные) риски, конкурентные риски, политические, социальные, экономические, финансовые риски, риски перевода, организационные и отраслевые риски.

Банковские риски. Управление кредитным риском. Банковские риски: операционные, технологические, стратегические, бухгалтерские, административные риски, риски инноваций, риски злоупотреблений, риски безопасности. Система внутреннего контроля в банках: основы, принципы и инструменты.

Сущность, особенности, классификации операционных и трансляционных рисков.

Валютный риск и его разновидности: экономический риск, риск перевода, риск сделок. Управление валютным риском.

Процентный риск. Управление в лицензии.

### **МОДУЛЬ 7 «Риски в маркетинге»**

Сущность и особенности маркетинговых рисков. Виды маркетинговых рисков: внешние и внутренние риски, объективные и субъективные.

Управление рисками при проведении маркетинговых исследований.

Проблемы ценообразования: недооценка двойственной роли сознания в решении о покупке, игнорирование степени осознания потребности в новом товаре, неадекватная ценовая политика, попадание в «неплатёжеспособный рыночный сегмент», ценовая не пластичность, конвертационные риски.

Риски, вызванные конкуренцией фирм на рынке. Сбыт продукции риски, с ним связанные. Выполнение маркетинговых работ: телефонный маркетинг, веер-маркетинг, маркетинг плотным взаимодействием.

## **МОДУЛЬ 8 «Экономическая безопасность и страхование предпринимательских рисков»**

Понятие страхования. Признаки экономической категории страхования.

Предпосылки для страхования рисков. Страховой договор, страховая премия. Лицензируемые виды страхования.

Франшиза: понятие, виды и влияние на страховое возмещение.

Сущность и особенности страхования предпринимательских рисков.

Классификации страхования предпринимательских рисков: страхование на случай простоя и страхование рисков, связанных с нарушением контрагентами договорных обязательств.

## **МОДУЛЬ 9 «Комплексный риск менеджмент»**

Предпосылки формирования современной парадигмы риск-менеджмента на уровне предприятия.

Концепция комплексной системы управления рисками предприятий (Enterprise-wide risk-management, EWRM).

Концепция EVA (Economic Value Added) и оценка эффективности деятельности компании. Экономическая добавленная стоимость. Понятие «свободные денежные потоки» (Free Cash Flow). Дисконтирование денежных потоков (Discounted Cash Flow). Способы расчета и интерпретация показателя EVA. Расчет чистых операционных активов. Определение величины операционного результата хозяйствования (NOPAT). EVA в качестве показателя финансового анализа. Оценка EVA как показателя стоимости.

Анализ ценности риска. Концепция RAROC (Risk-Adjusted Return on Capital - скорректированная на риск доходности капитала). История RAROC. Экономический капитал и виды риска. Экономическая прибыль. Ценность метода управления рисками.

## **МОДУЛЬ 10 «Измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы»**

Многообразие существующих теоретических и практических подходов к оценке эффективности управления в рамках фирмы. Три уровня системы управления и его эффективности.

Питер Друккер: ключевые факторы успеха фирмы. Основные факторы эффективности: действенность, экономичность, качество, производительность, качество трудовой жизни, прибыльность, нововведения.

Системный подход в оценке эффективности управления фирмой. Предпосылки становления и принципы системного подхода. Условия применения системного подхода. Показатели и основные группы критериев эффективности управления фирмой. Основные аспекты адаптации как свойств эффективного управления фирмой; оценка реальной эффективности управления; направления оценки экономичности. Изменения в технологическом базисе производства. Изменения в качестве рабочей силы.

Внешние и внутренние социально-экономические условия. Цели повышения эффективности управления.

Экспертные методы. Метод простой ранжировки, метод задания весовых коэффициентов, метод последовательных сравнений и метод парных сравнений.

### 5.3. Лабораторный практикум

Лабораторный практикум учебным планом не предусмотрен.

### 5.4. Практические занятия

## ОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 3а. Тематика, форма практических занятий (ПЗ) и их трудоемкость

Порядковый номер модуля. Цель практического занятия	Тематика практического занятия	Трудоем- кость, ч
<b>Модуль 1</b> Цель: изучение основных понятий риск-менеджмента, истории зарождения и перспектив развития	1. Классификации рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
<b>Модуль 2</b> Цель: рассмотрение классических и современных теорий рисков	1. Неоклассическая теория предпринимательского риска. 2. Кейсианская экономическая школа. 3. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
<b>Модуль 3</b> Цель: изучение особенностей типов фирм с повышенной степенью риска	1. Отличительные черты фирм с повышенной степенью риска. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
<b>Модуль 4</b> Цель: изучение методов управления рисками	1. Методы оценки рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
<b>Модуль 5</b> Цель: изучение системы управления рисками фирмы	1. Типовые алгоритмы риск-решений. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
<b>Модуль 6</b> Цель: ознакомление с особенностями управления финансовыми операционными и бизнес рисками предприятия	1. Критерии и особенности финансовых рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5

<b>Порядковый номер модуля. Цель практического занятия</b>	<b>Тематика практического занятия</b>	<b>Трудоем- кость, ч</b>
<b>Модуль 7</b> Цель: изучение основных маркетинговых рисков	1. Управление рисками в маркетинговых исследованиях. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
<b>Модуль 8</b> Цель: рассмотрение страхования предпринимательских рисков	1. Современная парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
<b>Модуль 9</b> Цель: изучение концепций комплексных систем риск менеджмента	1. Концепции комплексных систем риск менеджмента 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
<b>Модуль 10</b> Цель: измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы	1. Показатели и основные группы критериев эффективности управления фирмой. 2. Экспертные методы. 3. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5

### ОЧНО-ЗАОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ

Таблица 3б. Тематика, форма практических занятий (ПЗ) и их трудоемкость

<b>Порядковый номер модуля. Цель практического занятия</b>	<b>Тематика практического занятия</b>	<b>Трудоем- кость, ч</b>
<b>Модуль 1</b> Цель: изучение основных понятий риск-менеджмента, истории зарождения и перспектив развития	1. Классификации рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
<b>Модуль 2</b> Цель: рассмотрение классических и современных теорий рисков	1. Неоклассическая теория предпринимательского риска. 2. Кейсианская экономическая школа. 3. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
<b>Модуль 3</b> Цель: изучение особенностей типов фирм с повышенной степенью риска	1. Отличительные черты фирм с повышенной степенью риска. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5

<b>Порядковый номер модуля. Цель практического занятия</b>	<b>Тематика практического занятия</b>	<b>Трудоемкость, ч</b>
<b>Модуль 4</b> Цель: изучение методов управления рисками	1. Методы оценки рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
<b>Модуль 5</b> Цель: изучение системы управления рисками фирмы	1. Типовые алгоритмы риск-решений. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
<b>Модуль 6</b> Цель: ознакомление с особенностями управления финансовыми операционными и бизнес рисками предприятия	1. Критерии и особенности финансовых рисков. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
<b>Модуль 7</b> Цель: изучение основных маркетинговых рисков	1. Управление рисками в маркетинговых исследованиях. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1,5
<b>Модуль 8</b> Цель: рассмотрение страхования предпринимательских рисков	1. Современная парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия. 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
<b>Модуль 9</b> Цель: изучение концепций комплексных систем риск менеджмента	1. Концепции комплексных систем риск менеджмента 2. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1
<b>Модуль 10</b> Цель: измерение и оценка эффективности управления рисками фирмы	1. Показатели и основные группы критериев эффективности управления фирмой. 2. Экспертные методы. 3. Заслушивание рефератов и их обсуждение	1

## **6. Самостоятельная работа обучающихся и текущий контроль успеваемости**

### **6.1. Цели самостоятельной работы**

Формирование способностей к самостоятельному познанию и обучению, поиску источников, обобщению, оформлению и представлению полученных результатов, их критическому анализу, поиску новых и

неординарных решений, аргументированному отстаиванию своих предложений, умений подготовки выступлений и ведения дискуссий.

## 6.2. Организация и содержание самостоятельной работы

Самостоятельная работа заключается в изучении отдельных тем курса по заданию преподавателя по рекомендуемым им источникам, в подготовке к практическим занятиям, текущему контролю успеваемости, зачету.

Предусмотрено 10 практических занятий, которые защищаются посредством тестирования или устного опроса (по желанию обучающегося). Максимальная оценка за выполненную работу — 10 баллов.

Выполнение всех практических работ обязательно. В случае невыполнения практической работы по уважительной причине студент имеет право выполнить письменный реферат по согласованной с преподавателем теме модуля, по которому пропущена практическая работа.

Возможная тематическая направленность реферативной работы для каждого учебно-образовательного модуля представлена в таблице 4.

Таблица 4. Темы реферата

№ п/п	Модуль	Возможная тематика самостоятельной реферативной работы
1	Модуль 1	Классификации рисков
		Цели и функции риск-менеджмента
2	Модуль 2	Развитие классической теории предпринимательского риска
		Основы неоклассической теории предпринимательского риска
3	Модуль 3	Понятие и отличительные черты фирм с повышенной степенью риска
		Классификация фирм с повышенной степенью риска
4	Модуль 4	Метод многофакторного анализа риска
		Метод оценки стоимости риска (Value-at-Risk)
		Stress Testing: основные задачи и принципы
5	Модуль 5	Системный подход в управлении рисками
		Критерии Вальда и Сэдвиджа
6	Модуль 6	Сущность, критерии и особенности финансовых рисков
		Классификации финансовых рисков
7	Модуль 7	Классификация маркетинговых рисков

№ п/п	Модуль	Возможная тематика самостоятельной реферативной работы
		Сущность, критерии и особенности маркетинговых рисков
8	Модуль 8	Сущность и особенности страхования предпринимательских рисков
		Классификации страхования предпринимательских рисков
9	Модуль 9	Современная парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия
		Концепция комплексной системы управления рисками предприятий (EWRM)
10	Модуль 10	Показатели и основные группы критериев эффективности управления фирмой
		Методика оценки эффективности управления рисками фирмы

## 7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### 7.1. Основная литература по дисциплине

1. Вяткин, В.Н. Риск-менеджмент : учебник : в составе учебно-методического комплекса / В.Н. Вяткин, В.А. Гамза, Ф.В. Маевский. - 2-е изд. - Москва : Юрайт, 2022. - (Высшее образование). - Образовательная платформа Юрайт. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 07.07.2022. - ISBN 978-5-9916-3502-8. - URL: <https://urait.ru/bcode/489098> . - (ID=109444-0)

2. Круи, М. Основы риск-менеджмента = The essentials of risk management / М. Круи, Д. Галай, Р. Марк; научный редактор В.Б. Минасян. - Москва : Юрайт, 2022. - (Высшее образование). - Образовательная платформа Юрайт. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 07.07.2022. - ISBN 978-5-534-02578-1. - URL: <https://urait.ru/bcode/488656> . - (ID=106244-0)

3. Сергеев, А.А. Экономическая безопасность предприятия : учебник и практикум для вузов / А.А. Сергеев. - 3-е изд. - Москва : Юрайт, 2022. - (Высшее образование). - Образовательная платформа Юрайт. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 07.07.2022. - ISBN 978-5-534-14436-9. - URL: <https://urait.ru/bcode/494299> . - (ID=134272-0)

4. Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент : учебник : в составе учебно-методического комплекса / А.Н. Фомичев. - 8-е изд. ; перераб. - Москва : Дашков и К, 2021. - (Учебные издания для бакалавров). - ЭБС Лань. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 09.08.2022. -

ISBN 978-5-394-04273-7. - URL: <https://e.lanbook.com/book/229715> . - (ID=114297-0)

## 7.1. Дополнительная литература по дисциплине

1. Вякина, И.В. Экономическая безопасность предприятия: сущность, мониторинг и механизмы обеспечения : монография / И.В. Вякина. - Тверь : ТвГТУ, 2021. - 184 с. - Текст : непосредственный. - ISBN 978-5-7995-1145-6 : 499 р. 50 к. - (ID=139903-36)

2. Вякина, И.В. Экономическая безопасность предприятия: сущность, мониторинг и механизмы обеспечения : монография / И.В. Вякина; Тверской государственный технический университет. - Тверь : ТвГТУ, 2021. - 184 с. - Сервер. - Текст : электронный. - ISBN 978-5-7995-1145-6 : 0-00. - URL: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/Megapro/139127> . - (ID=139127-1)

3. Гончаренко, Л.П. Риск-менеджмент : учеб. пособие / Л.П. Гончаренко, С.А. Филин; Российская экономическая школа имени Г.В. Плеханова ; под ред. Е.Ф. Олейникова. - 3-е изд. ; стер. - М. : КноРус, 2008. - 213 с. - Библиогр. : с. 214 - 215. - Текст : непосредственный. - ISBN 5-390-00128-8 : 81 р. - (ID=75831-14)

4. Ермасова, Н.Б. Риск-менеджмент организации : учеб.-практ. пособие : в составе учебно-методического комплекса / Н.Б. Ермасова. - М. : Дашков и К, 2013. - 379 с. - (УМК-У). - Текст : непосредственный. - ISBN 978-5-394-01777-3 : 253 р. - (ID=96876-3)

5. Лелюхин, С.Е. Экономическая безопасность в предпринимательской деятельности : учебник для вузов по спец 38.05.01 "Экономическая безопасность" / С.Е. Лелюхин, А.М. Коротченков, У.В. Данилова. - Москва : Проспект, 2017. - 335 с. - Текст : непосредственный. - ISBN 978-5-392-23311-3 : 450 р. - (ID=87207-3)

6. Лихолетов, В.В. Экономическая безопасность инновационной политики : учебное пособие для вузов / В.В. Лихолетов. - 2-е изд. - Москва : Юрайт, 2022. - (Высшее образование). - Образовательная платформа Юрайт. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 07.07.2022. - ISBN 978-5-534-13499-5. - URL: <https://urait.ru/book/ekonomicheskaya-bezopasnost-innovacionnoy-politiki-497558> . - (ID=136775-0)

7. Риск-менеджмент инвестиционного проекта : учебник для вузов по экон. спец. / под ред.: М.В. Грачевой, А.Б. Секерина. - М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2009. - 544 с. - Текст : непосредственный. - ISBN 978-5-238-01506-4 : 350 р. - (ID=76631-10)

8. Симонов, С.Г. Экономическая безопасность предприятия малого бизнеса : учебное пособие / С.Г. Симонов, М.М. Махмудова, М.А. Хаматханова; Тюменский индустриальный университет. - Тюмень : Тюменский индустриальный университет, 2015. - ЭБС Лань. - Текст :

электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 01.08.2023. - ISBN 978-5-9961-1081-0. - URL: <https://e.lanbook.com/book/84163> . - (ID=155510-0)

9. Страхование дело и инструменты страховой защиты в риск-менеджменте : учеб. пособие для магистров : в составе учебно-методического комплекса / А.Г. Бадалова [и др.]. - Москва : Дашков и К, 2016. - (УМК-У). - ЭБС Лань. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 07.07.2022. - ISBN 978-5-394-02706-2. - URL: [https://e.lanbook.com/books/element.php?pl1\\_id=77286](https://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=77286) . - (ID=113580-0)

10. Яркина, Н.Н. Экономическая безопасность хозяйственной деятельности предприятия (организации) : курс лекций для направления подготовки 38.04.01 «Экономика» / Н.Н. Яркина; Керченский государственный морской технологический университет. - Керчь : Керченский государственный морской технологический университет, 2016. - ЭБС Лань. - Текст : электронный. - Режим доступа: по подписке. - Дата обращения: 01.08.2023. - URL: <https://e.lanbook.com/book/140645> . - (ID=155508-0)

## **7.2. Методические материалы**

1. Оценочные средства промежуточной аттестации в форме зачета дисциплины «Риск-менеджмент в деятельности фирмы» : для студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 Экономика. Профиль "Экономика фирмы" : в составе учебно-методического комплекса / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. МЕН ; разработ. О.А. Белоусов. - Тверь : ТвГТУ, 2017. - (УМК-Э). - **Текст : электронный.** - Режим доступа: с разрешения преподавателя. - (ID=122988-0)

2. Риск-менеджмент в деятельности фирмы : вопросы для подготовки к зачету для студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 Экономика. Профиль "Экономика фирмы" : в составе учебно-методического комплекса / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. МЕН ; разработ. О.А. Белоусов. - Тверь : ТвГТУ, 2016. - (УМК-ДМ). - Текст : электронный. - URL: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/MegaPro/122986> . - (ID=122986-0)

3. Риск-менеджмент в деятельности фирмы : методические указания по выполнению практических работ для студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 Экономика. Профиль "Экономика фирмы" : в составе учебно-методического комплекса / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. МЕН ; разработ. О.А. Белоусов. - Тверь : ТвГТУ, 2016. - (УМК-П). - Текст : электронный. - URL: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/MegaPro/122985> . - (ID=122985-0)

4. Риск-менеджмент в деятельности фирмы : тезисы лекций для студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 Экономика. Профиль

"Экономика фирмы" : в составе учебно-методического комплекса / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. МЕН ; разработ. О.А. Белоусов. - Тверь : ТвГТУ, 2016. - (УМК-Л). - Текст : электронный. - URL: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/Megapro/122983> . - (ID=122983-0)

5. Учебно-методический комплекс дисциплины части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 "Дисциплины (модули)" "Риск-менеджмент и экономическая безопасность фирмы". Направление подготовки магистров 38.04.01 Экономика. Направленность (профиль): Экономика фирмы : ФГОС 3++ / Тверской гос. техн. ун-т, Каф. МЕН ; сост. О.А. Белоусов. - 2022. - (УМК). - Текст : электронный. - 0-00. - URL: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/GetDoc/Megapro/115363> . - (ID=115363-1)

### **7.3. Программное обеспечение по дисциплине**

1. Операционная система Microsoft Windows: лицензии № ICM-176609 и № ICM-176613 (Azure Dev Tools for Teaching).
2. Microsoft Office 2019 Russian Academic: OPEN No Level: лицензия № 41902814.

### **7.4. Специализированные базы данных, справочные системы, электронно-библиотечные системы, профессиональные порталы в Интернет**

ЭБС и лицензионные ресурсы ТвГТУ размещены:

1. Ресурсы: <https://lib.tstu.tver.ru/header/obr-res>
2. ЭКТвГТУ: <https://elib.tstu.tver.ru/MegaPro/Web>
3. ЭБС "Лань": <https://e.lanbook.com/>
4. ЭБС "Университетская библиотека онлайн": <https://www.biblioclub.ru/>
5. ЭБС «IPRBooks»: <https://www.iprbookshop.ru/>
6. Электронная образовательная платформа "Юрайт" (ЭБС «Юрайт»): <https://urait.ru/>
7. Научная электронная библиотека eLIBRARY: <https://elibrary.ru/>
8. Информационная система "ТЕХНОРМАТИВ". Конфигурация "МАКСИМУМ" : сетевая версия (годовое обновление): [нормативно-технические, нормативно-правовые и руководящие документы (ГОСТы, РД, СНИПы и др.]. Диск 1,2,3,4. - М. : Технорматив, 2014. - (Документация для профессионалов). - CD. - Текст : электронный. - 119600 p. – (105501-1)
9. База данных учебно-методических комплексов: <https://lib.tstu.tver.ru/header/umk.html>

## **8. Материально-техническое обеспечение дисциплины**

При изучении дисциплины «Риск-менеджмент и экономическая безопасность» используются современные средства обучения: наглядные пособия, диаграммы, схемы. Возможна демонстрация практических заданий с помощью мультипроектора.

## **9. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации**

### **9.1. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации в форме экзамена**

Учебным планом экзамен по дисциплине не предусмотрен.

### **9.2. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации в форме зачета**

1. Шкала оценивания промежуточной аттестации — «зачтено», «не зачтено».

2. Вид промежуточной аттестации в форме зачета: по результатам текущего контроля знаний, обучающегося без дополнительных контрольных испытаний.

3. Критерии проставления зачета.

Оценка «зачтено» выставляется обучающемуся при условии выполнения им всех контрольных мероприятий, предусмотренных в Программе (при выполнении и защите практических работ, рефератов).

### **9.3. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации в форме курсового проекта**

Учебным планом курсовой проект не предусмотрен

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

Студенты очной формы обучения перед началом изучения дисциплины должны быть ознакомлены с возможностью получения экзаменационной оценки по результатам текущей успеваемости, с формами защиты выполненных лабораторных работ, а также планом выполнения курсовой работы.

В учебном процесс рекомендуется внедрение субъект-субъектной педагогической технологии, при которой в расписании каждого преподавателя определяется время консультаций студентов по закреплённому за ним модулю дисциплины.

Рекомендуется обеспечить студентов, изучающих дисциплину, электронными учебниками, учебно-методическим комплексом по дисциплине, включая методические указания к выполнению лабораторных

работ, к выполнению курсовой работы, а также всех видов самостоятельной работы.

### **11. Внесение изменений и дополнений в рабочую программу дисциплины**

Кафедра ежегодно обновляет содержание рабочих программ дисциплин, которые оформляются протоколами заседаний дисциплин, форма которых утверждена Положением о рабочих программах дисциплин, соответствующих ФГОС ВО.