

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Абдрахманов Данияр Мавлярович  
Должность: ректор ГБОУ ВО "БАГСУ"  
Дата подписания: 15.03.2024 10:48:54  
Уникальный программный ключ:  
6caf317d71a2c7d2f749ed2578795b66901352dd

Государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Башкирская академия государственной службы и управления  
при Главе Республики Башкортостан»

Кафедра экономической теории и социально-экономической политики

# **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

## **ДИСЦИПЛИНЫ**

### **Б1.В.ДВ.05.02 Антикризисное управление**

Уровень высшего образования  
БАКАЛАВРИАТ  
Направление подготовки  
38.03.01 «Экономика»

Направленность (профиль)  
Экономика и управление финансами

Квалификация  
бакалавр

Форма обучения  
очно-заочная

Уфа 2022

**Рабочая программа дисциплины Б1.В.ДВ.05.02 «Антикризисное управление» / сост. И.Ю. Карелин - Уфа: ГБОУ ВО «БАГСУ», 2022**

Рабочая программа предназначена для обучающихся очно-заочной формы обучения по направлению подготовки 38.03.01 Экономика

РЕКОМЕНДОВАНА заседанием кафедры экономической теории и социально-экономической политики  
протокол № 9 (234) от " 29 " апреля 2022г.

Заведующий кафедрой  
экономической теории и  
социально-экономической политики

Согласовано  
Руководитель ОПОП

И.Ю. Карелин

@ Карелин И.Ю., 2022 год  
@ ГБОУ ВО «БАГСУ», 2022 год

## Содержание

1	Цель и задачи освоения дисциплины .....	4
2	Требования к результатам обучения по дисциплине .....	5
3	Структура и содержание дисциплины .....	6
3.1	Структура дисциплины.....	6
3.2	Содержание разделов дисциплины .....	7
4	Учебно-методическое обеспечение дисциплины .....	15
4.1	Основная литература.....	15
4.2	Дополнительная литература.....	15
4.3	Периодические издания .....	16
4.4	Интернет-ресурсы.....	16
4.5	Методические указания по подготовке и работе на 16 практических занятиях (семинарам)	
4.6	Программное обеспечение, профессиональные базы данных и 19 информационные справочные системы современных информационных технологий .....	19
5	Материально-техническое обеспечение дисциплины .....	21
	Лист согласования рабочей программы дисциплины	
	Актуализация рабочей программе дисциплины	
	Фонд оценочных средств	
	Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины	
	Аннотация	

## **1 Цель и задачи освоения дисциплины**

**Целью** освоения дисциплины «Антикризисное управление» является формирование у обучающихся знаний, умений и навыков оценки различных рисков в новых мирохозяйственных условиях и риск-менеджмента.

Эта дисциплина направлена на формирование компетенции:

ПК-1 Способен разработать инновационный (инвестиционный) проект, учитывая современные тенденции развития и особенности функционирования региональной, национальной, мировой экономики.

### **Задачи:**

Основными задачами изучения учебной дисциплины «Антикризисное управление» являются:

- раскрыть закономерности и тенденции антикризисного управления, неизбежности циклического развития экономики;

- изучить сущность, причины и формы финансово-экономических рисков;

- рассмотреть глобальные проблемы современности и показать пути поиска их решения на локальном, региональном и глобальном уровнях;

- выявить роль органов управления предприятиями/ учреждениями/ организациями в урегулировании финансово-экономических рисков и в выходе из кризиса;

- показать место и роль России, ее регионов, предприятий различных видов экономической деятельности в условиях кризисных мирохозяйственных связей.

## 2 Требования к результатам обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих результатов обучения:

Код компетенции	Содержание компетенции	Индикатор компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций
ПК-1	Способен разработать инновационный (инвестиционный) проект, учитывая современные тенденции развития и особенности функционирования региональной, национальной, мировой экономики	ПК-1.1 Осуществляет сбор, обработку и анализ данных в процессе работы над конкретным инновационным (инвестиционным) проектом	<p><b><u>Знать:</u></b> методы осуществления сбора, обработки и анализа данных в процессе работы над конкретным инновационным (инвестиционным) проектом.</p> <p><b><u>Уметь:</u></b> осуществлять сбор, обработку и анализ данных в процессе работы над конкретным инновационным (инвестиционным) проектом.</p> <p><b><u>Владеть:</u></b> навыками осуществления сбора, обработки и анализа данных в процессе работы над конкретным инновационным (инвестиционным) проектом.</p>

		<p>ПК-1.2 Анализирует и интерпретирует социально – экономические показатели региона, страны и на основе этого анализа дает оценку современному экономическому развитию как отдельным регионам страны, так и страны в целом.</p>	<p><b><u>Знать:</u></b> методы анализа и интерпретации социально–экономических показателей региона, страны и оценки современного экономического развития как отдельным регионом страны, так и страны в целом.  <b><u>Уметь:</u></b> анализировать и интерпретировать социально–экономические показатели региона, страны и на основе этого анализа – оценивать современное экономическое развитие как отдельного региона страны, так и страны в целом.  <b><u>Владеть:</u></b> навыками анализа и интерпретации социально–экономических показателей региона, страны и оценки современного экономического развития как отдельным регионом страны, так и страны в целом.</p>
		<p>ПК-1.3 Формирует информационные обзоры, аналитические отчеты мировой экономики.</p>	<p><b><u>Знать:</u></b> методы формирования информационных обзоров, аналитических отчетов мировой экономики с учетом рисков.  <b><u>Уметь:</u></b> формировать информационные обзоры, аналитические отчеты мировой экономики с учетом рисков.  <b><u>Владеть:</u></b> навыками формирования информационных обзоров, аналитических отчетов мировой экономики с учетом рисков.</p>
		<p>ПК-1.4 Разрабатывает проектные решения в области профессиональной деятельности, участвует в реализации конкретных экономических проектов и программ.</p>	<p><b><u>Знать:</u></b> методы разработки проектных решений в области профессиональной деятельности, участия в реализации конкретных экономических проектов и программ.  <b><u>Уметь:</u></b> разрабатывать проектные решения в области профессиональной деятельности, участвовать в реализации конкретных экономических проектов и программ.  <b><u>Владеть:</u></b> навыками разработки проектных решений в области профессиональной деятельности, участия в реализации конкретных экономических проектов и программ.</p>

### 3 Структура и содержание дисциплины

#### 3.1 Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачетных единиц (180 академических часов).

Вид работы	Трудоемкость, академических часов	
	10, 11 семестры	всего
<b>Общая трудоёмкость</b>	<b>180</b>	<b>180</b>
<b>Контактная работа:</b>	<b>16</b>	<b>16</b>
Лекции (Л)	6	6
Практические занятия (ПЗ)	10	10
<b>Промежуточная аттестация</b>	<b>9</b>	<b>9</b>
<b>Самостоятельная работа:</b>	<b>155</b>	<b>155</b>
- самоподготовка (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий);	50	50
- подготовка к практическим занятиям;	53	53
- подготовка к оценке знаний и умений в рамках фонда тестовых вопросов и промежуточной аттестации в форме экзамена	52	52
<b>Вид итогового контроля</b>	<b>Экзамен</b>	<b>Экзамен</b>

#### Разделы дисциплины, изучаемые в 10 и 11 семестрах

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов			
		всего	аудиторная работа		внеауд. работа
			Л	ПЗ	
1	Сущность, факторы и классификация риска. Методы идентификации финансово-экономических рисков	41	1	2	38
2	Инвестиционный риск. Управление активами и пассивами. Риск-менеджмент	41	1	2	38
3	Цикличность развития экономики	42	2	2	38
4	Направления, методики и лучшие практики антикризисного управления	47	2	4	41
Контроль		9			9
Итого:		180	6	10	155+9

#### Практические занятия (семинары)

№ занятия	№ раздела	Тема	Кол-во часов
1	1	Сущность, факторы и классификация риска. Методы идентификации финансово-экономических рисков	2
2	2	Инвестиционный риск. Управление активами и пассивами. Риск-менеджмент	2
3	3	Цикличность развития экономики	2
4-5	4	Направления, методики и лучшие практики антикризисного управления	4

№ занятия	№ раздела	Тема	Кол-во часов
		Итого:	10

## 4.2 Содержание разделов дисциплины

Раздел 1. Сущность, факторы и классификация риска. Методы идентификации финансово-экономических рисков

Сущность риска. Факторы риска. Классификация и виды риска. Финансово-экономические риски: понятие, классификация. Понятие, цели и задачи риск-менеджмента.

Классификация методов идентификации финансово-экономических рисков. Формализованные методы идентификации финансово-экономических рисков. Интуитивные методы идентификации финансово-экономических рисков

Понятие рыночного риска. Методология Value-at-Risk. Коэффициенты бета и альфа.

Понятие кредитного риска. Страновой риск. Анализ кредитоспособности заемщика. Скоринг. Кредитный рейтинг. Рейтинговые агентства. Миграция рейтингов

Понятие операционного риска. Подходы к анализу и управлению операционным риском. Система внутреннего контроля.

Понятие банковского риска. Базельский комитет по банковскому надзору. Первое Базельское соглашение (Базель-I). Второе Базельское соглашение (Базель-II). Третье Базельское соглашение (Базель-III)

Раздел 2. Инвестиционный риск. Управление активами и пассивами. Риск-менеджмент

Понятие инвестиционного риска. Неопределенность инвестиций и методы ее учета.

Понятие, цели и задачи управления активами и пассивами. Методы управления активами и пассивами банка. Процентный риск (риск процентной ставки).

Стратегии управления финансово-экономическими рисками

Раздел 3. Цикличность развития экономики

Экономические циклы: К. Маркс, Н. Кондратьев, Йоз. Шумпетер. Стадии экономических циклов. Ключевые показатели цикличности экономического развития. Причины и виды кризисов.

Раздел 4. Направления, методики и лучшие практики антикризисного управления

Современное антикризисное управление в России. Стратегирование социально-экономического развития страны, регионов, предприятий.

Нормативно-методическое обеспечение антикризисного управления.



## 4 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

### 4.1 Основная литература

1. Внешнеэкономическая политика России в условиях глобальных вызовов: Монография / Ткаченко А.А. - М.: Вузовский учебник, НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 231 с.: 60x90 1/16. - (Научная книга) (Переплёт) ISBN 978-5-9558-0478-1 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/528414>
2. Мировая экономика и международные экономические отношения : учебник / под ред. В.К. Поспелова. — М. : ИНФРА-М, 2017. — 370 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа <http://www.znanium.com>]. — (Высшее образование: Бакалавриат). — [www.doi.org/10.12737/835](http://www.doi.org/10.12737/835). - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/399173>
3. Национальная и региональная экономическая безопасность России : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.А. Дадалко, Н.Г. Синявский. — М. : ИНФРА-М, 2016. — 363 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа <http://www.znanium.com>]. — (Высшее образование: Бакалавриат). — [www.doi.org/10.12737/20529](http://www.doi.org/10.12737/20529). - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/552890>
4. Управление финансово-экономическими рисками: учебное пособие <https://elar.urfu.ru/bitstream/10995/34722/1/978-5-7996-1459-1.pdf>

### 4.2 Дополнительная литература

1. Астрелина В. В. Управление ликвидностью в российском коммерческом банке : учеб. пособие/В. В. Астрелина, П. К. Бондарчук, П. С. Шальнов. М. : Форум: ИНФРА-М, 2012. 176 с.
2. Брейли Р. Принципы корпоративных финансов/ Р. Брейли, С. Майерс. М. : Олимп-Бизнес, 2012. 1 008 с.
3. Гончаренко Л. П. Риск-менеджмент/ Л. П. Гончаренко. 3-е изд., М. : КНОРУС, 2010. 216 с.
4. Ермасова Н. Б. Риск-менеджмент организации/ Н. Б. Ермасова. М. : Дашков и К, 2013. 379 с.
5. Князева Е. Г. Инвестиционная политика государства : учеб.-метод. комплекс дисциплины/Е. Г. Князева, Л. И. Юзвович. Екатеринбург : Изд-во Урал. ун-та. 2012. 88 с.
6. Кричевский М. Л. Финансовые риски/ М. Л. Кричевский. М. : КНОРУС, 2012. 248 с.
7. Макроэкономика /Н.С.Косов, Н.И.Саталкина, Ю.О.Терехова - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 264 с.: 60x90 1/16. - (Высшее образование: Бакалавриат) (Переплёт) ISBN 978-5-16-010315-0 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/483932>

8. Международные валютно-кредитные отношения: Учебник/Авагян Г. Л., Вешкин Ю. Г., 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Магистр, НИЦ ИНФРА-М, 2016. - 704 с.: 60x90 1/16 (Переплёт) ISBN 978-5-9776-0168-9 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/518978>
9. Международные стандарты по оценке риска ликвидности, стандартам и мониторингу. [Электрон. ресурс]/Базельский комитет по банковскому надзору. Режим доступа: <http://www.cbr.ru/today/ms/bn/2.pdf> Загл. с экрана.
10. Мировая экономика и международные экономические отношения: учеб. для академ. бакалавриата/авт. коллектив: Р. К. Щенин [и др.] ; под ред. Р. К. Щенина, В. В. Полякова.-М.:Юрайт,2015.-446 с.- (Бакалавр. Академический курс).
11. Новиков А. И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах/ А. И. Новиков, Т. И. Солодкая. М. : Дашков и К, 2012. 288 с.
12. Положение о порядке расчета величины кредитного риска на основе внутренних рейтингов [Электрон. ресурс] : проект. Доступ из справ.-поиск. системы «КонсультантПлюс».
13. Положение о порядке расчета кредитными организациями величины рыночного риска No 387-П [Электрон. ресурс] : утв. Банком России 28.09.2012. Доступ из справ.-поиск. Системы «КонсультантПлюс».
14. Положение о порядке расчета размера операционного риска No 346-П [Электрон. ресурс] : утв. Банком России 03.11.2009. Доступ из справ.-поиск. системы «КонсультантПлюс».
15. Принципы управления кредитным риском (Principles for the management of credit risk) [Электрон. ресурс]/Базельский комитет по банковскому надзору. Базель, сентябрь 2000 г. Режим доступа: <http://www.bis.org/publ/bcbs75.pdf> Загл. с экрана.
16. Российская Федерация. Законы. О банках и банковской деятельности No 395-1 [Электрон. ресурс] : федер. закон : [принят 02.12.1990]. Доступ из справ.-поиск. системы «КонсультантПлюс».
17. Российская Федерация. Законы. О несостоятельности (банкротстве) No 127-ФЗ [Электрон. ресурс] : федер. закон : [принят 26.10.2002]. Доступ из справ.-поиск. системы «КонсультантПлюс».
18. Тепман Л. Н. Управление рисками в условиях финансового кризиса/ Л. Н. Тепман. М. : ЮНИТИ, 2011. 295 с.
19. Финансовые риски <https://cyberleninka.ru/article/n/upravlenie-finansovo-ekonomicheskimi-riskami-v-usloviyah-globalizatsii>
20. Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций/ А. С. Шапкин. 8-е изд. М. : Дашков и К, 2012. 544 с.

### 4.3 Периодические издания

1. Журнал «Проблемы современной экономики» (<http://www.m-economy.ru/>).
2. Ежедневная деловая газета РБК (<https://www.rbc.ru/newspaper/>).
3. Газета Коммерсантъ. <https://www.kommersant.ru/>
4. Российская газета. <https://rg.ru/>

### 4.4 Интернет-ресурсы

1. [kommersant.ru](http://www.kommersant.ru). Загл. с экрана ; <http://www.expert.ru>. Загл. с экрана ; <http://www.forex.pf.ru>. Загл. с экрана.
2. Банк международных расчетов [Электрон. ресурс]: официальный сайт. Режим доступа: <http://www.bis.org/bcbs/index.htm>. Загл. с экрана.
3. Всемирный банк [Электрон. ресурс]: официальный сайт группы. Режим доступа: <http://www.worldbank.org.ru>. Загл. с экрана
4. Информационная система «ГАРАНТ» [Электрон. ресурс]: официальный сайт. Режим доступа: <http://www.garant.ru>. Загл. с экрана
5. Информационная система «Консультант Плюс» [Электрон. ресурс]: официальный сайт. Режим доступа: <http://www.consultant.ru>. Загл. с экрана.
6. Международный дискуссионный клуб «Валдай»  
<http://ru.valdaiclub.com/about/valdai/>
7. Министерство финансов РФ [Электрон. ресурс]: официальный сайт. Режим доступа: <http://www.minfin.ru>. Загл. с экрана.
8. Мировая экономика <http://www.ereport.ru/>
9. Мировая экономика, финансы и инвестиции <http://www.globfin.ru/news.php>
10. Российский экспортный центр <https://www.exportcenter.ru/>
11. Торгово-промышленная палата РФ <https://tpprf.ru/ru/>
12. Федеральная служба государственной статистики <http://www.gks.ru/>
13. Финансовая информация и аналитика [Электрон. ресурс]: сайт. Режим доступа: <http://www.rbc.ru>. Загл. с экрана ; <http://www>.
14. Центральный банк РФ [Электрон. ресурс]: официальный сайт. Режим доступа: <http://www.cbr.ru>. Загл. с экрана.
15. Экономика и финансы <http://www.finansy.ru/>
16. Электронно-библиотечная система ZNANIUM.COM <http://znanium.com/>

### 4.5 Методические указания к практическим занятиям

Практические занятия представляют собой детализацию лекционного теоретического материала, проводятся в целях закрепления курса и охватывают все основные разделы.

Основной формой проведения 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:

- а) ответы на вопросы, предлагаемые преподавателем;
- б) участие в дискуссиях;
- в) наличие и качество электронных презентаций и иных заданий;
- г) ассистирование преподавателю в проведении занятий.

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

#### **4.6 Программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы современных информационных технологий**

##### **Ауд. 206**

450008, г. Уфа, Заки Валиди, 40

Аудитория (72 посадочных места) для лекционных и практических занятий, текущего контроля и промежуточной аттестации, групповых и индивидуальных консультаций

##### **Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы**

Ноутбук Asus X58C – 1 шт.

Проектор BenQ MX503 (1024x768, 13000:1, 2700 Lumen)

Экран – 1 шт.

Доска классная – 1 шт.

Трибуна – 1 шт.

##### **Ауд. 304**

450008, г. Уфа, Заки Валиди, 40

Компьютерный класс №1

Кабинет информационных технологий в юридической деятельности

Кабинет самостоятельной работы обучающихся

Аудитория (29 посадочных мест) для лекционных и практических занятий, самостоятельной работы, текущего контроля и промежуточной аттестации, групповых и индивидуальных консультаций.

##### **Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы** Персональный компьютер – 13 шт. с выходом в Интернет

Принтер HP Color LJ Pro 200 M25 frw (CF147A) A4 цветной лазерный - 1 шт.

Проектор Beng MW526 DLP 3200Lm WXGA – шт.1

Экран на штативе 180x180см Dinon Tripod - 1 шт.

Доска маркерно - магнитная -1 шт.

Доска классная -1 шт.

**Ауд. 420** Кабинет социально-экономических дисциплин  
450008, г. Уфа, Заки Валиди, 40

Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа (практических занятий, лабораторных работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации:

- доска классная (1 шт.);
- парты (34 шт.);
- трибуна настольная – 1 шт.;
- экран настенный MW – 1 шт.;
- столы, стулья (68 посадочных мест);
- шкаф для документов закрытый 800\*420\*2100

Наглядные материалы по профилю кабинета – 30 шт.

**Ауд. 412** Кабинет экономической теории  
450008, г. Уфа, Заки Валиди, 40

Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа (практических занятий, лабораторных работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации:

- доска классная (1 шт.);
- доска маркерно-магнитная – 1 шт.;
- проектор EPSON EB 530 (1024x768) (1 шт.);
- экран для проектора (1 шт.);
- парты (12 шт.);
- столы, стулья (24 посадочных мест);
- трибуна настольная – 1 шт.;
- шкаф для документов закрытый 800\*420\*2100.

Наглядные материалы по профилю кабинета – 30 шт.

## **5 Материально-техническое обеспечение дисциплины**

Академия на законном основании располагает материально-техническим обеспечением образовательной деятельности (помещениями и оборудованием) для реализации дисциплины.

Помещения представляют собой учебные аудитории для проведения учебных занятий (включая проведение текущего контроля успеваемости) и промежуточной аттестации, предусмотренных по дисциплине, оснащенные оборудованием и техническими средствами обучения.

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

Допускается замена оборудования его виртуальными аналогами.

***К рабочей программе прилагается:***

- Фонд оценочных средств для проведения аттестации уровня сформированности компетенций обучающихся по дисциплине (модулю), который разрабатывается в виде отдельного документа.

Государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
**«Башкирская академия государственной службы и управления  
при Главе Республики Башкортостан»**

Кафедра экономической теории и социально-экономической политики

**Фонд  
оценочных средств**  
по дисциплине  
**«Антикризисное управление»**

**БАКАЛАВРИАТ**

Направление подготовки  
38.03.01 Экономика

Форма обучения  
очно-заочная

Уфа 2022

Фонд оценочных средств предназначен для контроля знаний обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика по дисциплине «Антикризисное управление».

Составитель: И.Ю. Карелин

Фонд оценочных средств обсужден на заседании кафедры экономической теории и социально-экономической политики

Заведующий кафедрой  
экономической теории и  
социально-экономической политики

Фонд оценочных средств является приложением к рабочей программе по дисциплине «Антикризисное управление».



**Раздел 1 – Паспорт фонда оценочных средств  
по дисциплине «Антикризисное управление»**

**1. Основные сведения о дисциплине**

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачетных единиц (180 академических часов).

Вид работы	Трудоемкость, академических часов	
	10, 11 семестры	всего
<b>Общая трудоёмкость</b>	<b>180</b>	<b>180</b>
<b>Контактная работа:</b>	<b>16</b>	<b>16</b>
Лекции (Л)	6	6
Практические занятия (ПЗ)	10	10
<b>Промежуточная аттестация</b>	<b>9</b>	<b>9</b>
<b>Самостоятельная работа:</b>	<b>155</b>	<b>155</b>
- <i>самоподготовка (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий);</i>	50	50
- <i>подготовка к практическим занятиям;</i>	53	53
- <i>подготовка к оценке знаний и умений в рамках фонда тестовых вопросов и промежуточной аттестации в форме экзамена</i>	52	52
<b>Вид итогового контроля</b>	<b>Экзамен</b>	<b>Экзамен</b>

## 2. Требования к результатам обучения по дисциплине, формы их контроля и виды оценочных средств

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих результатов обучения:

Формируемые компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций	Типы контроля
УК-10 Способен формировать нетерпимое отношение к коррупционному поведению	<p><b>Знать:</b> методы разработки проектных решений в области профессиональной деятельности, участия в реализации конкретных экономических проектов и программ.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- методы разработки проектных решений в области профессиональной деятельности, участия в реализации конкретных экономических проектов и программ.</li> <li>- методы формирования информационных обзоров, аналитических отчетов мировой экономики с учетом рисков.</li> <li>- методы анализа и интерпретации социально–экономических показателей региона, страны и оценки современного экономического развития как отдельным регионом страны, так и страны в целом.</li> <li>- методы осуществления сбора, обработки и анализа данных в процессе работы над конкретным инновационным (инвестиционным) проектом.</li> </ul>	<p>Тестирование по лекционному материалу</p> <p>Письменные домашние работы.</p> <p>Устное индивидуальное собеседование – опрос</p>
	<p><b>Уметь:</b> разрабатывать проектные решения в области профессиональной деятельности, участвовать в реализации конкретных экономических проектов и программ.</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- разрабатывать проектные решения в области профессиональной деятельности, участвовать в реализации конкретных экономических проектов и программ.</li> <li>- формировать информационные обзоры, аналитические отчеты мировой экономики с учетом рисков.</li> <li>- осуществлять сбор, обработку и анализ данных в процессе работы над конкретным инновационным (инвестиционным) проектом.</li> <li>- анализировать и интерпретировать социально–экономические показатели региона, страны и на основе этого анализа – оценивать современное экономическое развитие как отдельного региона страны, так и страны в целом.</li> </ul>	<p>Выполнение и защита индивидуальных творческих заданий.</p> <p>Устное индивидуальное собеседование.</p>

<p><b><u>Владеть:</u></b> навыками разработки проектных решений в области профессиональной деятельности, участия в реализации конкретных экономических проектов и программ</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- навыками разработки проектных решений в области профессиональной деятельности, участия в реализации конкретных экономических проектов и программ.</li> <li>- навыками формирования информационных обзоров, аналитических отчетов мировой экономики с учетом рисков.</li> <li>- навыками осуществления сбора, обработки и анализа данных в процессе работы над конкретным инновационным (инвестиционным) проектом.</li> <li>- навыками анализа и интерпретации социально–экономических показателей региона, страны и оценки современного экономического развития как отдельным регионом страны, так и страны в целом.</li> </ul>	<p>Выполнение индивидуального творческого задания. Выполнение задач</p>
---	---

**Соответствие разделов (тем) дисциплины и контрольно-измерительных материалов и их количества**

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины (модуля), практики, программы итоговой аттестации	Контрольно-измерительные материалы, количество заданий или вариантов			
		Тестовые задания	Типовые вопросы	РГР (РГЗ)	Курсовой проект (проект)
1	Сущность, факторы и классификация риска. Методы идентификации финансово-экономических рисков	<b>5</b>	<b>15</b>	-	-
2	Инвестиционный риск. Управление активами и пассивами. Риск-менеджмент	<b>5</b>	<b>15</b>	-	-
3	Цикличность развития экономики	<b>5</b>	<b>15</b>	-	-
4	Направления, методики и лучшие практики антикризисного управления	<b>5</b>	<b>15</b>		
	Всего	<b>20</b>	<b>60</b>	-	-

**Оценочные средства**

**Блок А**

**А.1 Фонд тестовых заданий по дисциплине**

**Вариант 1**

1 В организациях желательны конфликты, которые:

- а) помогают увидеть разнообразие точек зрения
- б) приводят к образованию противоборствующих группировок
- в) приводят к увольнению сотрудников

2 Операциями по управлению ценными бумагами следует считать:

- а) принятие решений по управлению без собраний акционеров
- б) анализ рынка ценных бумаг и выбор цели портфеля ценных бумаг
- в) принятие решений по управлению с собранием акционеров

3 Крупные сделки совершаются внешним управляющим с согласия комитета:

- а) учредителей
- б) организаторов
- в) кредиторов

4 Политика, обеспечивающая правомерность и допустимость риска конкретного вида в рискованных решениях, разрабатываемых применительно к конкретным социально-экономическим системам и ситуациям – это ... управления риском

- а) система
- б) группа
- в) стратегия

5 Риск, связанный с неопределенностью возврата вложенных средств и получения дохода

- а) Маркетинговый
- б) Инвестиционный
- в) Производственный

6 Право внешнего управляющего на самостоятельное распоряжение имуществом должника ограничивается осуществлением сделок в отношении имущества, не превышающего ... от балансовой стоимости активов на момент заключения сделки:

- а) 20 %
- б) 10 %
- в) 30 %

7 Из внешних факторов следует отметить источники управленческого риска, вызванные кризисом социально-экономического развития страны и отдельных регионов, а также рыночные источники:

- а) социально-экономического развитие человека
- б) маркетинг
- в) социально-экономического развития страны

8 Особенность процесса обоснования стратегии в антикризисном управлении организацией состоит в том, что на ... этапе предусмотрено обязательное сравнение маркетинговой стратегии и цели, а также рыночных возможностей организации

- а) первом
- б) четвертом
- в) третьем

9 Кризисы, охватывающие всю социально-экономическую систему, называются:

- а) общие кризисы
- б) микрокризисы
- в) макрокризисы

10 Существует такой метод реализации изменений:

- а) добавочный
- б) дополнительный
- в) принудительный

## **Вариант 2**

1 Комплекс мероприятий, которые организация намеревается выполнить для стабилизации ситуации на рынке и по выходу из кризиса, – это такая антикризисная программа:

- а) дополнительная
- б) добавочная
- в) маркетинговая

2 Согласно договору подряда арбитражный управляющий несет материальную ответственность за долги предприятия:

- а) возникшие после заключения договора подряда
- б) неурегулированные перед работниками во время действия его полномочий
- в) возникшие до заключения договора подряда перед государством

3 Система мероприятий по финансовому оздоровлению предприятия, реализуемых с помощью сторонних юридических или физических лиц:

- а) репарация
- б) стагнация
- в) санация

4 Состояние, когда по крайней мере одна структурная составляющая системы находится в переходном периоде, но при этом на состоянии системы это вообще не сказывается, — это ... состояние системы:

- а) квазистабильное
- б) микростабильное
- в) макростабильное

5 Кризис, отражающий нарушение закона пропорционального развития общественного производства, — это такой кризис:

- а) политический
- б) экономический
- в) структурный

6 Во взаимосвязи между функционированием и развитием возникает такая тенденция развития, которая выражается в периодическом наступлении кризисов:

- а) циклическая
- б) синусоидальная
- в) невротическая

7 Какими 2 видами ограничено государственное регулирование экономики:

- а) финансовым и кредитноденежным
- б) социальным и финансовым
- в) кредитно денежным и социальным

8 Что не относится к динамике выхода из кризиса:

- а) Эффективность косвенного воздействия и регулирования институциональных форм в рыночной среде
- б) Сила государства
- в) Стимулирования конкуренции
- г) Завершение структурной перестройки экономике

9 На какие 3 группы можно разделить всю совокупность норм, через которое осуществляется государственное регулирование при антикризисном управлении

- а) общесистемные нормы, специальные нормы, целевые нормы
- б) налоговые нормы, частные нормы, экономические нормы
- в) правовые, экологические, научно-технические нормы

10 Антикризисное управление – это:

а) Создание предпосылок, позволяющих избежать кризисных явлений в социально-экономической деятельности предприятия, индивидуального предпринимателя, отрасли

б) Процесс применения определенных мер и действий, позволяющих осуществить социально-экономическое оздоровление деятельности предприятия, индивидуального предпринимателя, отрасли, т.е. не допустить их банкротства

в) Процесс анализа социально-экономической деятельности предприятия, индивидуального предпринимателя, отрасли, целью которого является выявление причин установившегося кризиса

## **БЛОК В**

### **Темы для самостоятельного изучения:**

1. Сущность и определение риска.
2. Объективная и субъективная природа риска.
3. Факторы риска.
4. Классификация риска.
5. Виды риска.
6. Цель и задачи риск-менеджмента.
7. Методы идентификации риска.
8. Формализованные методы идентификации риска.
9. Интуитивные методы идентификации риска.
10. Понятие и виды рыночного риска.
11. Основы методологии Value-at-Risk.
12. Методы вычисления Value-at-Risk.
13. Оценка рыночного риска с использованием бета- и альфа-коэффициентов.
14. Понятие кредитного риска.
15. Дефолт как проявление кредитного риска.
16. Внутренний и внешний кредитный риск.

17. Понятие и виды странового риска.
18. Методики оценки странового риска.
19. Классический анализ кредитоспособности заемщика.
20. Скоринговая модель оценки кредитного риска.
21. Кредитный рейтинг. Миграция кредитных рейтингов.
22. Модель CreditMetrics.
23. Понятие и виды операционного риска.
24. Подходы к анализу и управлению операционным риском.
25. Система внутреннего контроля над операционным риском.
26. Внутренние и внешние процедуры контроля над операционным риском.
27. Понятие банковского риска.
28. Базельский комитет по банковскому надзору: основные задачи, участники, соглашения.
29. Основные положения Первого базельского соглашения.
30. Основные положения Второго базельского соглашения.
31. Основные положения Третьего базельского соглашения.
32. Подходы к определению требований к капиталу под кредитный риск.
33. IRB-подход к определению требований к капиталу под кредитный риск.
34. Подходы к определению требований к капиталу под операционный риск.
35. Основные принципы надзорного процесса по базельским соглашениям.
36. Понятие правового и репутационного риска кредитной организации.
37. Понятие и виды инвестиционного риска.
38. Понятие неопределенности инвестиционного проекта.
39. Основные характеристики методов учета неопределенности инвестиционного проекта.
40. NPV как показатель экономической эффективности проекта.
41. Анализ чувствительности инвестиционного проекта.
42. Метод предельных значений параметров инвестиционного проекта.
43. Основные стадии процесса управления рисками.
44. Стратегии избежания риска.
45. Стратегии удержания риска.
46. Стратегии передачи риска.
47. Интеграция как метод диссипации риска.
48. Диверсификация как метод диссипации риска.
49. Понятие лимитирования риска.
50. Методы локализации риска.
51. Резервирование средств как основа самострахования.
52. Роль страхования в снижении степени риска.
53. Отличительные особенности страхования и хеджирования риска.
54. Понятие управления активами и пассивами предприятия.
55. Задачи управления активами и пассивами предприятия.
56. Понятие процентного риска банка.



57. Базовый процентный риск и риск временного разрыва.
58. GAP-анализ степени процентного риска.
59. Дюрация активов и пассивов банка. Анализ GAP-дюрации (GAPD).
60. Основные методы управления активами и пассивами банка.

### **A3 Семинарские занятия: вопросы для дискуссии**

1. Риск в предпринимательской деятельности.
2. Объективная и субъективная природа риска.
3. Роль риск-менеджмента в системе управления организацией.
4. Математическая аналогия как метод идентификации риска.
5. Применение стресс-тестирования при анализе риска.
6. Преимущества и недостатки методологии Value-at-Risk.
7. Особенности и ограничения применения дельта-нормального метода вычисления VAR.
8. Понятие нормального гауссовского распределения вероятностей и его применение в оценке рыночного риска.
9. Метод исторических симуляций в оценке рыночного риска.
10. Преимущества и недостатки вычисления VAR методом Монте-Карло.
11. Применение модели геометрического броуновского движения при моделировании динамики цен активов и процентных ставок.
12. Применение альфа- и бета-коэффициентов при оценке рыночного риска.
13. Дефолт как проявление кредитного риска.
14. Страновой риск как составная часть внешнего кредитного риска.
15. Индекс BERRI как метод оценки уровня странового риска.
16. Цели и задачи анализа кредитоспособности заемщика.
17. Методы анализа кредитоспособности заемщика.
18. Скоринговая модель оценки кредитного риска.
19. Особенности модели CreditMetrics.
20. Применение теории экстремальных значений при оценке уровня операционного риска.
21. Банковский риск: понятие, классификация, актуальность.
22. Роль базельских соглашений в регулировании банковской деятельности в России.
23. Особенности IRB-подхода к расчету требований к капиталу для покрытия кредитных рисков.
24. Базель-III как реакция на глобальный финансовый кризис.
25. Правовой и репутационный риск в функционировании коммерческого банка.
26. Имущественные интересы инвестора как объект инвестиционного риска.
27. Применение метода предельных значений параметров для учета полной неопределенности инвестиционного проекта.
28. Отказ от деятельности как стратегия управления риском.
29. Сходства и различия страхования и хеджирования риска.

30. Портфельная теория Марковица.
31. Страхование как отказ от части дохода для снижения уровня риска.
32. Процентный риск как одна из основных областей управления активами и пассивами коммерческого банка.
33. Методы устранения дисбаланса активов и пассивов при наличии GAP-разрыва.
34. Дюрация Маколи.
35. Секьюритизация как метод управления активами и пассивами.
36. Понятие экономического капитала и его отличие от балансового.
37. Применение показателя RAROC для определения оптимальной структуры капитала.
38. Методология RiskMetrics

#### **А4 Работа в системе дистанционного обучения:**

1. Консультации и тесты с использованием телекоммуникационных средств.
2. Презентационные материалы, статьи и обзоры из Интернет-ресурсов, обмен полезными ссылками и глоссарий.
3. Применение интернет-платформы дистанционного обучения:
  - «Национальная платформа открытого образования» (<http://npoed.ru>);
  - «Ё-Стади» (<http://your-study.ru>) и др.

### **БЛОК С**

Учебным планом не предусмотрено написание курсовых работ

### **БЛОК D**

#### **Вопросы для самопроверки обучающихся при подготовке к экзамену**

1. Институциональные и правовые механизмы обеспечения антикризисного управления в России.
2. Антикризисное управление: проблемы и пути их решения.
3. Особенности нормативно-правовой базы, регулирующей процессы несостоятельности в России и за рубежом.
4. Экономические основы возникновения неплатежеспособности и банкротства организаций.
5. Банкротство организаций и меры по его предупреждению.
6. Процедуры банкротства (на примере отдельной процедуры).
7. Антикризисное управление на различных стадиях жизненного цикла организации.
8. Государственное регулирование кризисных ситуаций в экономике.
9. Средства и методы государственной поддержки организаций в кризисной ситуации.
10. Реструктуризация налоговой задолженности как способ заключения мирового соглашения.
11. Диагностика экономического состояния неплатежеспособной организации.

12. Анализ финансового состояния кризисной организации в рамках внутреннего и внешнего аудита.
13. Финансовое оздоровление организации.
14. Разработка бизнес-плана финансового оздоровления организации.
15. Разработка стратегии по выводу неплатежеспособной организации из состояния кризиса.
16. Формирование антикризисной маркетинговой стратегии организации.
17. Маркетинговая программа бизнес-плана финансового оздоровления организации.
18. Финансовая политика неплатежеспособной организации.
19. Управление денежными потоками, дебиторской и кредиторской задолженностями в период финансового оздоровления организации.
20. Разработка антикризисной инвестиционной политики.
21. Разработка антикризисной инновационной политики.
22. Организационно-производственный менеджмент в неплатежеспособной организации.
23. Политика управления персоналом в условиях антикризисного управления.
24. Организационные аспекты деятельности арбитражного управляющего и членов его команды.
25. Саморегулируемая организация арбитражных управляющих: функции, права и обязанности.
26. Особенности антикризисного управления в странах с развитой рыночной экономикой.
27. Разработка технологий антикризисного управления.
28. Риски в антикризисном управлении.
29. Кризисы и типы антикризисного управления.
30. Кризисы организаций.
31. Антициклическая и антикризисная политика государства.
32. Региональное антикризисное управление.
33. Муниципальный антикризисный менеджмент.
34. Управление ресурсами фирмы в кризисных условиях.
35. Мотивация персонала в условиях неопределенности.
36. Управление конфликтами в условиях антикризисного управления организацией.
37. Ликвидация организаций.
38. Развитие законодательства о несостоятельности в России.
39. Предупреждение несостоятельности.
40. Анализ причин неплатежеспособности организаций в России.
41. Упрощенные процедуры банкротства.
42. Реинжиниринг бизнес-процессов в антикризисном менеджменте.
43. Конкурсное производство на неплатежеспособном предприятии.
44. Методические основы антикризисного управления предприятием.

45. Финансовое прогнозирование и финансовое планирование в антикризисном управлении.
46. Оценка бизнеса в кризисных условиях.
47. Мероприятия по выводу организации из кризиса.
48. Риск-менеджмент в неплатежеспособной организации.
49. Влияние деловой среды на организацию в кризисных условиях.
50. Антикризисное управление организацией в современных условиях

