



**УТВЕРЖДЕНО**

на заседании Ученого совета

ОУП ВО «АТиСО»

16 декабря 2025 г., протокол № 17

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**  
**РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ В ИННОВАЦИОННОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ**

**Направление/специальность подготовки**  
**38.05.01 Экономическая безопасность**

**Специализация/профиль/программа подготовки**  
**Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности**

**Уровень высшего образования**  
**Специалитет**

**Москва**  
**2025**

## 1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины является формирование следующих профессиональных компетенций и индикаторы их достижения

Код и наименование профессиональной компетенции	Код и наименование индикатора достижений профессиональной компетенции
ПК-1. Способен проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов	ПК-1.1 Знание методологии и методик анализа угроз экономической безопасности; методов планирования и осуществления инновационных проектов. ПК-1.2 Умение использовать методологию и методику анализа угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов. ПК-1.3 Владение навыками анализа угроз и планирования инновационных проектов.
ПК-2. Способен осуществлять мероприятия по получению юридически значимой информации о рисках и угрозах экономической безопасности	ПК-2.1 Знание методов анализа и оценки экономических рисков. ПК-2.2. Умение применять методы анализа и оценки экономических рисков. ПК-2.3 Владение навыками анализа, оценки и прогнозирования экономических рисков; навыками поиска юридически значимой информации.

**Формированию компетенций служит достижение следующих результатов образования:**

**знания:**

понятийного аппарата управления рисками, основ организации риск-менеджмента при планировании и осуществлении инновационных проектов; нормативно-правовых актов и стандартов (государственных, межгосударственных, международных) о рисках экономической безопасности;

**умения:**

идентифицировать и анализировать риски экономической безопасности и осуществлении инновационных проектов, использовать методы идентификации, анализа и оценки рисков, производить процедуру оценки рисков инновационных проектов;

осуществлять анализ информации о рисках экономической безопасности, определять меры воздействия на риски экономической безопасности;

**навыки:**

применения методов анализа и оценки рисков инновационных проектов. использования методов идентификации и оценки рисков экономической безопасности.

## 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО

Дисциплина **РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ В ИННОВАЦИОННОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ** относится к дисциплинам по выбору части, формируемой участниками образовательных отношений, учебного плана, программы подготовки по направлению *38.05.01 Экономическая безопасность*.

### 3. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 з.е., 108 ч.

#### 3.1. Содержание (дидактика) дисциплины

КУРС	СЕМЕСТР	Наименование разделов и дидактических единиц	ВСЕГО	Аудиторные занятия			Самостоятельная работа студентов	Формируемая компетенция, %	
				ВСЕГО	Лекции	Практические занятия		ПК-1	ПК-2
5	10	<b>Раздел 1. Понятийный аппарат риск-менеджмента.</b> 1.1 Риск и неопределенность. 1.2 Факторы и причины рисков. 1.3 Классификация рисков. 1.4 Понятие инновации и инновационной деятельности предприятия.	18	6	4	2	12	10	10
5	10	<b>Раздел 2. Оценка рисков.</b> Раздел 2. Оценка рисков. 2.1 Процесс управления рисками. 2.2 Организация риск-менеджмента на предприятии. 2.3 Подпроцесс идентификации и анализа рисков. 2.4 Количественные и качественные методы идентификации и анализа рисков. 2.5 Методы оценки рисков.	52	20	12	8	32	60	60
5	10	<b>Раздел 3. Методы воздействия на риски.</b> 3.1 Избежание риска. 3.2 Контроль и предупреждение риска. 3.3 Страхование риска. 3.4 Передача риска. 3.5 Хеджирование рисков. 3.6 Трансферт рисков.	38	13	10	3	25	30	30
<b>Всего за 10 семестр</b>			108	39	26	13	69	100	100
<b>Всего по дисциплине</b>			108	39	26	13	69	100	100

#### 3.2. Аудиторный практикум

№ п/п	Номер и наименование раздела дисциплины	Тема практического занятия	Объем, ауд. часов
1	Раздел 1. Понятийный аппарат риск-менеджмента.	Факторы возникновения рисков. Классификация рисков	2
2	Раздел 2. Оценка рисков.	Идентификация рисков: применение метода мозгового штурма для идентификации рисков предприятия (организации)	2
3		Методы идентификации и анализа рисков	4
4		Картирование рисков	2
5	Раздел 3. Методы воздействия на риски.	Методы воздействия на риски	3
<b>Всего за 10 семестр</b>			13

#### 3.3. Самостоятельная работа студента (СРС)

№ п/п	Номер и наименование раздела дисциплины	Содержание учебного задания	Объем, часов
1	Раздел 1. Понятийный аппарат риск-менеджмента.	Изучение литературы по вопросам раздела 1. Подготовка к тесту	12
2	Раздел 2. Оценка рисков.	Изучение литературы по вопросам раздела 2	4
3		Определение рисков качественными и количественными методами по кейсу-задаче	12

4		Подготовка к тесту	4
5		Методы Парето для определения значимых рисков в деятельности предприятия. Оценка эффективности проекта (NPV, PP, IRR, PI) с учетом рисков проекта	12
6	Раздел 3. Методы воздействия на риски.	Выполнение кейс-задачи	20
7		Изучение литературы по разделу 3	5
<b>Всего за 10 семестр</b>			<b>69</b>

#### 4. ФОРМЫ КОНТРОЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Промежуточная аттестация проводится в формах: зачет.

#### 5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

##### Основная литература:

№ п/п	Автор	Название	Издательство	Год	Наличие в ЭБС*
1.	Тихомиров Н. П. Тихомирова Т. М.	Теория риска	Юнити-Дана	2020	<a href="https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=615777">https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=615777</a>
2.	Фомичев А. Н.	Риск-менеджмент	Дашков и К°	2021	<a href="https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=684289">https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=684289</a>
3.	Вельмисова Д. В.	Социология рисков и неопределенностей	Санкт-Петербургский государственный экономический университет	2022	<a href="https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=699841">https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=699841</a>
4.	Балдин К. В. Передеряев И. И. Голов Р. С.	Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия	Дашков и К°	2021	<a href="https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=684196">https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=684196</a>
5.	Блинов А. О. Угрюмова Н. В.	Управление изменениями	Дашков и К°	2021	<a href="https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=684279">https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=684279</a>

\*ЭБС – электронно - библиотечная система

##### Дополнительная литература:

№ п/п	Автор	Название	Издательство	Год	Наличие в ЭБС
1.	Тихомиров Н. П. Тихомирова Т. М.	Теория риска	Юнити-Дана	2020	<a href="https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=615777">https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=615777</a>
2.		Антикризисное управление	Дашков и К°	2022	<a href="https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=62183">https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=62183</a>

					8
3.	Цай Е. Л. Шевчук И. А. Нехайчук Д. В.	Управление изменениями	Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова	2020	<a href="https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=611322">https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=611322</a>

## 6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Помещения, в которых проводятся занятия, представляют собой учебные аудитории для проведения учебных занятий. Данные аудитории оснащенные оборудованием и техническими средствами обучения.

**Компьютеры, информационно-телекоммуникационные сети, аппаратно-программные и аудиовизуальные средства, находящиеся в учебных аудиториях:**

- ноутбук Lenovo B50 (для преподавателя) с выходом в сеть интернет;
- проектор EPSONEB-W22 (проектор SANYOPROxtrax);
- акустическая система Microlab;
- экран для проектора;
- доска маркерная (ученическая доска);

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой и имеют возможность подключения к сети интернет и обеспечивают доступ к электронной информационно-образовательной среде академии.

## 7. ФОНДЫ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕРКИ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ/ПОДКОМПЕТЕНЦИЙ

### 7.1 Типовые вопросы для подготовки к зачету при проведении

- 1 . Различия между традиционным и современным подходом к управлению рисками.
- 2 Сравнение трех основных методик организации риск-менеджмента на нефинансовых предприятиях.
- 3 Организация процесса риск-менеджмента на нефинансовых предприятиях.
- 4 Построение рискографии нефинансовой компании.
- 5 Методы качественной оценки рисков.
- 6 Основные методы количественной оценки рисков.
- 7 Способы минимизации операционных рисков.
- 8 Оценочные резервы как способ минимизации рисков.
- 9 Особенности выбора метода минимизации рисков.
- 10 Особенности и трудности применения VAR при оценке рыночных рисков.
- 11 Стоимостные метрики риска: EaR, CFaR - методика их измерения.
- 12 Измерение валютных операционных рисков.
- 13 Маркетинговые стратегии управления валютными операционными рисками.

- 14 Параметры ликвидного рынка.
- 15 Факторы, влияющие на динамику ликвидности рынка.
- 16 Виды рисков ликвидности и особенности их учёта.
- 17 Источники риска неплатежеспособности корпорации.
- 18 Проблемы в оценке операционных рисков.
- 19 Источники операционного риска. Анализ и способы определения операционного риска.
- 20 Методы оценки и управления операционным риском.
- 21 Особенности управления стратегическим риском компании.
- 22 Сбалансированная система показателей и стратегический риск.
- 23 Дельта нормальный метод расчета VaR.
- 24 Метод исторического моделирования расчета VaR.
- 25 Расчет VaR методом Монте-Карло.
- 26 Хеджирование с помощью форвардов и фьючерсов
- 27 Хеджирование с помощью опционов.
- 28 Стратегии хеджирования валютных рисков.
- 29 Методы хеджирования рисков процентных ставок.
- 30 Методы управления кредитным риском.
- 31 Модель расчета кредитного риска CreditMetrics.
- 32 Модель Мертона расчета риска дефолта.
- 33 Кредитные деривативы.
- 34 Оценка эффективности размещения капитала с учетом риска с помощью RAROC.

## **7.2 Критерии оценки**

**Оценка устного (письменного) ответа студента на экзамене, зачете; зачете с оценкой:**

- оценка «отлично», «зачтено» выставляется студенту, если он владеет понятийным аппаратом, демонстрирует глубину и полное овладение содержанием учебного материала, в котором легко ориентируется;

- оценка «хорошо», «зачтено» выставляется студенту, за умение грамотно излагать материал, но при этом содержание и форма ответа могут иметь отдельные неточности;

- оценка «удовлетворительно», «зачтено» выставляется, если студент обнаруживает знания и понимание основных положений учебного материала, но излагает его неполно, непоследовательно, допускает неточности в определении понятий, не умеет доказательно обосновывать свои суждения;

- оценка «неудовлетворительно», «не зачтено» выставляется, если студент имеет разрозненные, бессистемные знания, не умеет выделять главное и второстепенное, допускает ошибки в определении понятий, искажает их смысл.

**ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН УСИЛЕННОЙ  
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ**

**СВЕДЕНИЯ О СЕРТИФИКАТЕ ЭП**

Владелец: **Образовательное учреждение профсоюзов  
высшего образования «Академия труда и социальных  
отношений» <rector@atiso.ru>**  
Сертификат: ced6d31cf7f8ff8b33158f88a623ef6f645eee53  
Действителен с 19.05.2024 по 31.12.2099