

Сибирский институт управления – филиал РАНХиГС  
Образовательная программа 38.03.01 Экономика,  
направленность(профиль) «Инвестиционный анализ»

### Обязательный минимум освоения учебной дисциплины

## УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМИ РИСКАМИ

Преподаватель: Алексеев Михаил Анатольевич, доктор экономических наук, доцент,  
профессор кафедры бизнес-аналитики и статистики, [alekseev-ma@ranepa.ru](mailto:alekseev-ma@ranepa.ru)

### **I. В ходе освоения дисциплины студентом должны быть выполнены и сданы:**

1. Практическая работа «Регулирование рисков инвестиционного портфеля» (15 баллов);
2. Выступления на семинаре с докладом, сообщением (10 баллов);
3. Ответ на опрос, оппонирование выступающим (10 баллов);
4. Аналитическое исследование «Управление инвестиционными рисками» (10 баллов);
5. Контрольная работа «Анализ инвестиционных рисков» (20 баллов);
6. Презентация результатов анализа деятельности организации с точки зрения основных бенефициаров (10 баллов);
7. Зачет в форме итогового опроса (5 вопросов), тестирование (25 баллов)

### **II. По окончании изучения дисциплины студент должен продемонстрировать:**

- Способность анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т. д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений;
- Способность самостоятельно сделать аналитическое заключение на основе расчета и анализа;
- Выполнять основные процедуры проверки правильности расчета экономических показателей;
- Навыки комплексного анализа статистических показателей финансовой деятельности;
- Знание и умения в пояснении структуры, формы и содержания аналитической записки;
- Умения в аргументированном и обоснованном анализе статистических показателей финансовой отчетности и биржевой информации.

### **III. Аттестация по дисциплине предусмотрена в форме зачета с оценкой.**

Ответ на теоретический вопрос в устной форме на основе списка вопросов в рабочей программе учебной дисциплины (единичный выбор преподавателем).

Оценка выполнения практических заданий проводится в форме собеседования обучающегося и преподавателя по алгоритму выполнения задания, его практической направленности, интерпретации результатов и пр.

Оценка, полученная в результате прохождения зачета, учитывается при расчете итоговой оценки по дисциплине наряду с баллами, накопленными в ходе текущего

контроля в течение периода изучения дисциплины. Подсчет итоговой оценки производится в соответствии с регламентом работы по балльно-рейтинговой системе.

<b>100- балльная шкала</b>	<b>5-балльная шкала</b>
0 -50	Не зачтено
51 - 64	Зачтено (удовлетворительно)
65 – 84	Зачтено (хорошо)
85– 100	Зачтено (Отлично)

**IV. Итоговая отметка студента будет рассчитываться следующим образом / или выставляться по следующим критериям:** для получения зачета необходимо набрать не менее 50 баллов из 100 возможных.

**V. Краткий перечень обязательных учебно-методических материалов для подготовки к зачету с оценкой.**

1. Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. — 4-е URL: <http://www.iprbookshop.ru/85180.html> — Режим доступа: ЭБС «IPRbooks», требуется авторизация.

2. Воронцовский, А. В. Управление рисками: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. — Москва: Юрайт, 2019. — 414 с. — URL: <https://biblio-online.ru/bcode/433253> – Режим доступа: ЭБС Юрайт, требуется авторизация.

3. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Юрайт, 2019. — 381 с. — URL: <https://biblioonline.ru/bcode/432142> – Режим доступа: ЭБС Юрайт, требуется авторизация.

4. Плотников, А. Н. Учет факторов риска и неопределенности при оценке эффективности инвестиционных проектов / А. Н. Плотников. – Москва: ИНФРА-М, 2016. - 80 с. - URL: <https://new.znanium.com/catalog/product/754387> - Режим доступа: ЭБС Znanium.com, требуется авторизация.

5. Уколов, А. И. Оценка рисков: учебник / А. И. Уколов. - 2-е изд. стер. - Москва: Директ-Медиа, 2018. - 627 с. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=445268> - Режим доступа: ЭБС «Унив. б-ка ONLINE», требуется авторизация.