

**МИНОБРНАУКИ РОССИИ**

федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
**«Кузбасский государственный технический университет имени Т. Ф. Горбачева»**

Филиал КузГТУ в г. Новокузнецке

УТВЕРЖДЕНО

Заместитель директора,  
совмещающий обязанности директора  
филиала КузГТУ в г. Новокузнецке

\_\_\_\_\_ Баранов Ю.А.

«29» мая 2026г.

**Рабочая программа дисциплины**

Рынок ценных бумаг

Направление подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность

Направленность (профиль) 02 Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Присваиваемая квалификация «Экономист\»

Формы обучения: очная

Год набора 2025

Новокузнецк 2026 г.

Рабочая программа обсуждена на заседании учебно-методического совета филиала КузГТУ в г. Новокузнецке

Протокол № 6 от 29.05.2026

Зав. Кафедрой ИТиЭД

  
\_\_\_\_\_

подпись

В. В. Шарлай

СОГЛАСОВАНО:

Заместитель директора по УР

  
\_\_\_\_\_

подпись

Т. А. Евсина

**1 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине "Риск-менеджмент", соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы**

Освоение дисциплины направлено на формирование:

профессиональных компетенций:

ПК-8 - Способность проводить оценку эффективности проектов и анализ предложений по их совершенствованию

универсальных компетенций:

УК-1 - Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий

**Результаты обучения по дисциплине определяются индикаторами достижения компетенций**

**Индикатор(ы) достижения:**

Осуществляет критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывает стратегию действий.

Проводит оценку эффективности проектов и анализ предложений по их совершенствованию.

**Результаты обучения по дисциплине:**

Знать: сущность риска, рискового ландшафта, рискованной экспозиции; подходы, механизмы, инструменты риск-менеджмента; основы стратегического управления.

Знать: сущность категории экономической эффективности; критерии эффективности проектов.

Уметь: анализировать риски; вырабатывать стратегию действий в проблемной ситуации.

Уметь: определять эффективность проектов; анализировать экономические проекты.

Владеть: методами анализа рисков; методами управления рисками.

Владеть: методами оценки эффективности проектов; навыками анализа предложений по совершенствованию проектов.

**2 Место дисциплины "Риск-менеджмент" в структуре ОПОП специалитета**

Для освоения дисциплины необходимы знания умения, навыки и (или) опыт профессиональной деятельности, полученные в рамках изучения следующих дисциплин: Менеджмент и маркетинг, Оценка рисков, Управление организацией (предприятием), Математическое моделирование рискованных ситуаций.

Дисциплина входит в Блок 1 Дисциплины (модули) ОПОП. Цель дисциплины - получение обучающимися знаний, умений, навыков и (или) опыта профессиональной деятельности, необходимых для формирования компетенций, указанных в пункте 1.

**3 Объем дисциплины "Риск-менеджмент" в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся**

Общая трудоемкость дисциплины "Риск-менеджмент" составляет 4 зачетных единицы, 144 часа.

Форма обучения	Количество часов		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
<b>Курс 4/Семестр 8</b>			
Всего часов			144
<b>Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий):</b>			14
Аудиторная работа			
Лекции			4
Лабораторные занятия			
Практические занятия			10
Внеаудиторная работа			
Индивидуальная работа с преподавателем:			
Консультация и иные виды учебной деятельности			
<b>Самостоятельная работа</b>			130

Форма обучения	Количество часов		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Форма промежуточной аттестации			зачет

#### 4 Содержание дисциплины "Риск-менеджмент", структурированное по разделам (темам)

##### 4.1. Лекционные занятия

Раздел дисциплины, темы лекций и их содержание	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Тема 1. Общие представления о риске и риск-менеджменте Понятие и теория риска. Сущность, цели и задачи риск-менеджмента. Этапы развития теории и практики риск-менеджмента. Профессия «риск-менеджер». Сущность управления рисками.			1
Тема 2. Риск как объект диагностики, оценки и управления. Понятие и виды рисков. Управленческая диагностика рисков. Формула риска. Таксономия рисков. Пирамида риска.			1
Тема 3. Фрактальный подход в риск-менеджменте Фрактальная модель организации. Рисковый ландшафт и рисковые характеристики. Целостная модель организации. Структурный фрактал. Процессный фрактал. Ресурсный фрактал. Жизненные циклы организации. Внутренние и внешние стейкхолдеры организации. Ценности организации. Рисковая экспозиция.			1
Тема 4. Механизм риск-менеджмента Модель функции риск-менеджмента в управлении организацией. Рутинный и чрезвычайный риск-менеджмент. Человеческий аспект управления рисками. Финансовый аспект управления рисками. Инструменты и механизмы риск-менеджмента.			1
Итого			4

##### 4.2 Практические (семинарские) занятия

Тема занятия	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
1. Общие представления о риске и риск-менеджменте.			2
2. Риск как объект диагностики, оценки и управления.			2
3. Фрактальный подход в риск-менеджменте.			4
4. Механизм риск-менеджмента.			2
Итого			10

##### 4.3 Самостоятельная работа студента и перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Вид СРС	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Ознакомление с содержанием основной и дополнительной литературы, методических материалов, конспектов лекций для подготовки к занятиям			130
Итого			130

#### 5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине "Риск-менеджмент"

##### 5.1 Паспорт фонда оценочных средств

### Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю)

Дисциплина направлена на формирование следующих компетенций выпускника:

Форма (ы) текущего контроля	Компетенции, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)	Индикатор (ы) достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине (модулю)	Уровень
Контрольная работа, тестирование	ПК-8	Проводит оценку эффективности проектов и анализ предложений по их совершенствованию.	<p><b>Знать:</b> сущность категории экономической эффективности; критерии эффективности проектов.</p> <p><b>Уметь:</b> определять эффективность проектов; анализировать экономические проекты</p> <p><b>Владеть:</b> методами оценки эффективности проектов; навыками анализа предложений по совершенствованию проектов.</p>	Высокий или средний
Контрольная работа, тестирование	УК-1	Осуществляет критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывает стратегию действий.	<p><b>Знать:</b> сущность риска, рискового ландшафта, рискованной экспозиции; подходы, механизмы, инструменты риск-менеджмента; основы стратегического управления.</p> <p><b>Уметь:</b> анализировать риски; вырабатывать стратегию действий в проблемной ситуации</p> <p><b>Владеть:</b> методами анализа рисков; методами управления рисками.</p>	Высокий или средний

**Высокий уровень достижения компетенции** - компетенция сформирована частично, рекомендованные оценки: отлично, хорошо, зачтено.  
**Средний уровень достижения компетенции** - компетенция сформирована частично, рекомендованные оценки: хорошо, удовлетворительно, зачтено.  
**Низкий уровень достижения компетенции** - компетенция не сформирована, оценивается неудовлетворительно или не зачтено.

## 5.2. Контрольные задания или иные материалы

Текущий контроль успеваемости и аттестационные испытания обучающихся могут быть организованы с использованием ресурсов ЭИОС КузГТУ. Полный перечень оценочных материалов расположен в ЭИОС КузГТУ: <https://el.kuzstu.ru/login/index.php>.

Текущий контроль успеваемости и аттестационные испытания могут проводиться в письменной и (или) устной, и (или) электронной форме.

### 5.2.1. Оценочные средства при текущем контроле

Текущий контроль по темам дисциплины заключается в проведении контрольных работ и (или) тестирования.

#### **Контрольная работа:**

В ходе контрольной работы обучающийся дает письменный ответ на два задания, которые представляют собой контрольные вопросы.

Критерии оценивания:

- 85-100 баллов - при правильном и полном ответе на два задания;
- 65-84 баллов - при правильном и полном ответе на одно из заданий и правильном, но не полном ответе на второй задание;
- 25-64 баллов - при правильном и неполном ответе на одно или оба задания;
- 0-24 баллов - при отсутствии правильных ответов.

Шкала оценивания ответов на задания:

Количество баллов	0-24	25-64	65-84	85-100
Шкала оценивания	неуд	удовл	хорошо	отлично

#### **Примерный перечень контрольных вопросов:**

##### **Тема 1.** Общие представления о риске и риск-менеджменте

1. Что такое риск?
2. В чем заключается сущность риска?
3. Какие функции выполняет риск-менеджер в организации?
4. В чем заключается сущность управления рисками?

##### **Тема 2.** Риск как объект диагностики, оценки и управления.

1. Какие существуют виды рисков?
2. Что такое формула риска?
3. Что такое таксономия рисков?
4. Что такое пирамида риска?

##### **Тема 3.** Фрактальный подход в риск-менеджменте

1. В чем сущность фрактальной модели организации.?
2. Что такое рисковый ландшафт?
3. Что такое рисковая экспозиция?
4. Приведите примеры внутренних и внешних стейкхолдеров организации.

##### **Тема 4.** Механизм риск-менеджмента

1. В чем сущность рутинного риск-менеджмента?
2. В чем сущность чрезвычайного риск-менеджмента?
3. Какие аспекты управления рисками существуют?
4. Приведите примеры инструментов риск-менеджмента.

### **Тестирование:**

При проведении текущего контроля обучающимся необходимо ответить на тесты по каждой теме. Тестирование может быть организовано с использованием ресурсов ЭИОС КузГТУ.

Критерии оценивания: оценка студента определяется процентом верных ответов.

Шкала оценивания при проведении тестирования:

Критерии оценивания:

- 85- 100 баллов - при ответе на <84% вопросов
- 64 - 84 баллов - при ответе на >64 и <85% вопросов
- 50 - 64 баллов - при ответе на >49 и <65% вопросов
- 0 - 49 баллов - при ответе на <45% вопросов

Количество баллов	0-49	50-64	65-84	85-100
Шкала оценивания	неуд	удовл	хорошо	отлично

### **Примеры тестовых заданий для проведения текущего контроля:**

**Тема 1.** Общие представления о риске и риск-менеджменте

1. Выберите верное утверждение:

- А. Любое действие, с одной стороны, уменьшает риск, а с другой - увеличивает.
- Б. Любое действие либо уменьшает риск, либо увеличивает его.
- Г. Любое действие только уменьшает риск.
- Д. Любое действие только увеличивает риск.

2. Какими тенденциями характеризуется современное общества с позиции риск-менеджмента?

- А. Рост информированности.
- Б. Рост псевдоинформированности.
- В. Накопление и концентрация мощности.

Г. Снижение многомерности.

3. Выберите верное утверждение:

А. Состав рисков, входящих в актуальный рисковый профиль российских предприятий, не сильно отличается от аналогичных параметров западных фирм.

Б. Состав рисков, входящих в актуальный рисковый профиль российских предприятий, сильно отличается от аналогичных параметров западных фирм.

В. Состав рисков, входящих в актуальный рисковый профиль российских предприятий, идентичен аналогичным параметрам западных фирм.

Г. Невозможно определить степень сходства между рисковыми портфелями российских и западных фирм.

**Тема 2.** Риск как объект диагностики, оценки и управления.

1. Главная задача риск-менеджмента состоит в том, чтобы...

А. Выявить те действия, которые, если их предпринять в ближайшем будущем, защитят от неудач в более отдаленном будущем.

Б. Целенаправленно наблюдать за развитием событий, чтобы вовремя обнаруживать потенциальные проблемы.

В. Предлагать своевременные меры по поддержанию защищаемого объекта.

Г. Все перечисленное.

2. Что подталкивает к принятию рисков?

- А. Щедрость
- Б. Жадность
- В. Конкуренция
- Г. Монопольное положение на рынке

3. Какие виды рисков выделяют по частоте реализации?

- А. Внутренние и внешние.
- Б. Частые и редкие.
- В. Ближайшие и отсроченные.
- Г. Высокие, средние и низкие.

**Тема 3.** Фрактальный подход в риск-менеджменте

1. В целостной организации сосуществуют, по крайней мере, ... фрактала:

- А. Два
- Б. Три
- В. Четыре
- Г. Пять

2. Какие виды фракталов организации рассматриваются в рамках риск-менеджмента?

- А. Структурный
- Б. Статичный
- В. Иерархичный
- Г. Процессный

3. ... — совокупность стадий развития, которые проходит организация за период своего существования.

- А. Жизненный цикл
- Б. Фрактал
- В. Рисковый ландшафт
- Г. Рисковая экспозиция

#### **Тема 4. Механизм риск-менеджмента**

1. Процедуры и мероприятия, которые осуществляются формально как текущая работа обычной управленческой службы - это...

- А. Рутинный риск-менеджмент
- Б. Чрезвычайный риск-менеджмент
- В. Стратегический риск-менеджмент
- Г. Текущий риск-менеджмент

2. Какие аспекты управления рисками выделяют?

- А. Внутренние и внешние.
- Б. Высокие, средние и низкие.
- В. Человеческий и финансовый.
- Г. Рутинный и чрезвычайный.

3. Что относят к базовым методами риск-менеджмента?

- А. Отказ от риска
- Б. Снижение риска
- В. Принятие риска
- Г. Передача риска

#### **5.2.2 Оценочные средства при промежуточной аттестации**

**Формой промежуточной аттестации** является зачет, в процессе которого определяется сформированность обозначенных в рабочей программе компетенций.

Инструментом измерения сформированности компетенций являются:

- ответы обучающихся на контрольные задания;
- результаты выполнения тестовых заданий при работе в ЭИОС.

При проведении промежуточного контроля обучающийся отвечает на 2 случайно выбранных вопроса. Опрос может проводиться в письменной и (или) устной форме. Промежуточный контроль может быть также проведен с использованием ресурсов ЭИОС КузГТУ в форме тестирования. В этом случае обучающийся выполняет 30 тестовых заданий, выбранных случайным образом.

#### **Ответы на вопросы:**

Критерии оценивания при ответе на вопросы:

- 85-100 баллов - при правильном и полном ответе на два вопроса;
- 65-84 баллов - при правильном и полном ответе на один из вопросов и правильном, но не полном ответе на другой из вопросов;
- 50-64 баллов - при правильном и неполном ответе только на один или оба вопроса;
- 0-49 баллов - при отсутствии правильных ответов на вопросы.

Шкала оценивания ответов на вопросы:

Количество баллов	0-64	65-100
Шкала оценивания	незачет	зачет

#### **Примерный перечень вопросов к зачету:**

1. Понятие и теория риска.
2. Сущность, цели и задачи риск-менеджмента.
3. Этапы развития теории и практики риск-менеджмента.
4. Профессия «риск-менеджер».
5. Сущность управления рисками
6. Понятие и виды рисков.
7. Управленческая диагностика рисков.

8. Формула риска.
9. Таксономия рисков.
10. Пирамида риска.
11. Фрактальная модель организации.
12. Рисковый ландшафт и рисковые характеристики.
13. Целостная модель организации.
14. Структурный фрактал.
15. Процессный фрактал.
16. Ресурсный фрактал.
17. Жизненные циклы организации.
18. Внутренние и внешние стейкхолдеры организации.
19. Ценности организации.
20. Рисковая экспозиция.
21. Модель функции риск-менеджмента в управлении организацией.
22. Рутинный и чрезвычайный риск-менеджмент.
23. Человеческий аспект управления рисками.
24. Финансовый аспект управления рисками.
25. Инструменты и механизмы риск-менеджмента.

**Тестирование:**

Критерии оценивания: оценка студента определяется процентом верных ответов.

Шкала оценивания при проведении тестирования:

Процент верных ответов	0-64	65-100
Шкала оценивания	незачет	зачет

**Примеры тестовых заданий для проведения промежуточного контроля:**

1. Выберите верное утверждение:
  - А. Любое действие, с одной стороны, уменьшает риск, а с другой – увеличивает.
  - Б. Любое действие либо уменьшает риск, либо увеличивает его.
  - Г. Любое действие только уменьшает риск.
  - Д. Любое действие только увеличивает риск.
2. Что подталкивает к принятию рисков?
  - А. Щедрость
  - Б. Жадность
  - В. Конкуренция
  - Г. Монопольное положение на рынке
3. ... — совокупность стадий развития, которые проходит организация за период своего существования.
  - А. Жизненный цикл
  - Б. Фрактал
  - В. Рисковый ландшафт
  - Г. Рисковая экспозиция

**5.2.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций**

1. Текущий контроль успеваемости обучающихся, осуществляется в следующем порядке: в конце завершения освоения соответствующей темы обучающиеся, по распоряжению педагогического работника, убирают все личные вещи, электронные средства связи и печатные источники информации.

Для подготовки ответов на задания обучающиеся используют чистый лист бумаги любого размера и ручку. На листе бумаги обучающиеся указывают свои фамилию, имя, отчество (при наличии), номер учебной группы и дату проведения текущего контроля успеваемости.

Научно-педагогический работник устно формулирует два вопроса, которые обучающийся может записать на подготовленный для ответа лист бумаги.

В течение установленного научно-педагогическим работником времени обучающиеся письменно формулируют ответы на заданные вопросы. По истечении указанного времени листы бумаги с подготовленными ответами обучающиеся передают научно-педагогическому работнику для последующего оценивания результатов текущего контроля успеваемости.

При подготовке ответов на задания обучающимся запрещается использование любых электронных и печатных источников информации. В случае обнаружения научно-педагогическим

работником факта использования обучающимся при подготовке ответов на вопросы указанных источников информации обучающемуся по результатам проведения текущего контроля выставляется 0 баллов и назначается дата повторного прохождения текущего контроля успеваемости.

Результаты текущего контроля доводятся до сведения обучающихся в течение трех учебных дней, следующих за днем проведения текущего контроля успеваемости.

Обучающиеся, которые не прошли текущий контроль успеваемости в установленные сроки, обязаны пройти его в срок до начала процедуры промежуточной аттестации по дисциплине в соответствии с расписанием промежуточной аттестации.

Результаты прохождения процедур текущего контроля успеваемости обучающихся учитываются при оценивании результатов промежуточной аттестации обучающихся.

2. Промежуточная аттестация обучающихся проводится после завершения обучения по дисциплине в семестре в соответствии с календарным учебным графиком и расписанием промежуточной аттестации.

Для успешного прохождения процедуры промежуточной аттестации по дисциплине обучающиеся должны:

- получить положительные результаты по всем предусмотренным рабочей программой формам текущего контроля успеваемости;

- получить положительные результаты аттестационного испытания.

Для успешного прохождения аттестационного испытания обучающийся в течение времени, установленного научно-педагогическим работником, осуществляет подготовку ответов на два вопроса, выбранных в случайном порядке.

Для подготовки ответов используется чистый лист бумаги и ручка.

На листе бумаги обучающиеся указывают свои фамилию, имя, отчество (при наличии), номер учебной группы и дату проведения аттестационного испытания.

При подготовке ответов на вопросы обучающимся запрещается использование любых электронных и печатных источников информации.

По истечении указанного времени, листы с подготовленными ответами на вопросы обучающиеся передают научно-педагогическому работнику для последующего оценивания результатов промежуточной аттестации.

В случае обнаружения научно-педагогическим работником факта использования обучающимся при подготовке ответов на вопросы указанные источники информации обучающемуся по результатам проведения промежуточного контроля выставляется 0 баллов и назначается дата повторного прохождения аттестационного испытания.

Результаты промежуточной аттестации обучающихся размещаются в ЭИОС КузГТУ.

Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация обучающихся могут быть организованы с использованием ЭИОС КузГТУ, порядок и формы проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся при этом не меняются.

## **6 Учебно-методическое обеспечение**

### **6.1 Основная литература**

### **6.2 Дополнительная литература**

### **6.3 Методическая литература**

## **7 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»**

ЭИОС КузГТУ:

а) Электронная библиотека КузГТУ. – Текст: электронный // Научно-техническая библиотека Кузбасского государственного технического университета им. Т. Ф. Горбачева : сайт. – Кемерово, 2001 – . – URL: <https://elib.kuzstu.ru/>. – Текст: электронный.

б) Портал.КузГТУ : Автоматизированная Информационная Система (АИС) : [сайт] / Кузбасский государственный технический университет им. Т. Ф. Горбачева. – Кемерово : КузГТУ, [б. г.]. – URL: <https://portal.kuzstu.ru/>. – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст: электронный.

с) Электронное обучение : [сайт] / Кузбасский государственный технический университет им. Т.

## **8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины "Риск-менеджмент"**

Самостоятельная работа обучающегося является частью его учебной деятельности, объемы самостоятельной работы по каждой дисциплине (модулю) практике, государственной итоговой аттестации, устанавливаются в учебном плане.

Самостоятельная работа по дисциплине (модулю), практике организуется следующим образом:

1. До начала освоения дисциплины обучающемуся необходимо ознакомиться с содержанием рабочей программы дисциплины (модуля), программы практики в следующем порядке:

1.1 содержание знаний, умений, навыков и (или) опыта профессиональной деятельности, которые будут сформированы в процессе освоения дисциплины (модуля), практики;

1.2 содержание конспектов лекций, размещенных в электронной информационной среде КузГТУ в порядке освоения дисциплины, указанном в рабочей программе дисциплины (модуля), практики;

1.3 содержание основной и дополнительной литературы.

2. В период освоения дисциплины обучающийся осуществляет самостоятельную работу в следующем порядке:

2.1 подготовка к опросам и (или) тестированию в соответствии с порядком, установленном в рабочей программе дисциплины (модуля);

2.2 подготовка к промежуточной аттестации в соответствии с порядком, установленном в рабочей программе дисциплины (модуля).

В случае затруднений, возникших при выполнении самостоятельной работы, обучающемуся необходимо обратиться за консультацией к педагогическому работнику. Периоды проведения консультаций устанавливаются в расписании консультаций.

## **9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине "Риск-менеджмент", включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем**

Для изучения дисциплины может использоваться следующее программное обеспечение:

1. Mozilla Firefox
2. Google Chrome
3. 7-zip
4. ESET NOD32 Smart Security Business Edition
5. Kaspersky Endpoint Security
6. Браузер Спутник

## **10 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине "Риск-менеджмент"**

Для реализации программы учебной дисциплины предусмотрены специальные помещения:

1. Помещения для самостоятельной работы обучающихся должны оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети Интернет и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде Организации.

2. Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

## **11 Иные сведения и (или) материалы**

1. Образовательный процесс осуществляется с использованием как традиционных так и современных интерактивных технологий.

В рамках аудиторных занятий применяются следующие интерактивные методы:

- разбор конкретных примеров;
- мультимедийная презентация.

2. Проведение групповых и индивидуальных консультаций осуществляется в соответствии с расписанием консультаций по темам, заявленным в рабочей программе дисциплины, в период

освоения дисциплины и перед промежуточной аттестацией с учетом результатов текущего контроля.