

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тольяттинский государственный университет»

ФТД.В.03
(индекс дисциплины)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Риски в инновационной деятельности

(наименование дисциплины)

по направлению подготовки
38.04.02 Менеджмент

направленность (профиль)
Управление инновациями

Форма обучения: заочная

Год набора: 2022

Общая трудоемкость: 3 ЗЕ

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр	4	Итого
Форма контроля	Зачет	
Вид занятий		
Лекции	4	4
Лабораторные		
Практические	4	4
Руководство: курсовые работы (проекты) / РГР		
Промежуточная аттестация	0,25	0,25
Контактная работа	8,25	8,25
Самостоятельная работа	96	96
Контроль	3,75	3,75
Итого	108	108

Рабочую программу составил(и):

Доцент департамента магистратуры (бизнес-программ), кандидат экономических наук,
доцент, Шерстобитова А.А.

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

Рецензирование рабочей программы дисциплины:



Отсутствует



Рецензент

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

Рабочая программа дисциплины составлена на основании ФГОС ВО и учебного плана
направления подготовки 38.04.01 Экономика

Срок действия рабочей программы дисциплины до «24» мая 2025 г.

СОГЛАСОВАНО

Руководитель департамента предпринимательства

«__» _____ 20__ г.

(подпись)

Н.С. Карцева

(И.О. Фамилия)

УТВЕРЖДЕНО

На заседании департамента магистратуры (бизнес-программ)

(протокол заседания № 1 от «30» августа 2021 г.).

1. Цель освоения дисциплины

Цель освоения дисциплины – формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков в области рисков инновационной деятельности.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплины и практики, на освоении которых базируется данная дисциплина: «Управление инновационными проектами».

Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: Производственная практика (преддипломная практика).

3. Планируемые результаты обучения

Формируемые и контролируемые компетенции (код и наименование)	Индикаторы достижения компетенций (код и наименование)	Планируемые результаты обучения
ПК-2. Способен руководить инновационными проектами, выявлять и оценивать тенденции технологического развития производства	ПК-2.1 – демонстрирует знания руководства инновационными проектами	Знать современные методы управления рисками в инновационной деятельности
		Уметь применять навыки руководства инновационными проектами на основе знаний управления рисками
		Владеть навыками управления рисками в управлении инновационными проектами
	ПК – 2.2 – демонстрирует умения оценивать тенденции технологического развития производства	Знать системы обеспечения и методический инструментарий управления рисками инновационной деятельности предприятия
		Уметь оценивать тенденции технологического развития производства опираясь систему обеспечения и методический инструментарий управления рисками инновационной деятельности предприятия
		Владеть навыками применения системы обеспечения управления рисками инновационной деятельности предприятия в условиях технологического развития производства

4. Структура и содержание дисциплины

Модуль (раздел)	Вид учебной работы	Наименование тем занятий (учебной работы)	Семестр	Объем, ч.	Баллы	Интерактив, ч.	Формы текущего контроля (наименование оценочного средства)
Риски в инновационной деятельности	Лек	Тема 1. Сущность, цель и функции управления рисками инновационной деятельности предприятия	4	1	7		Промежуточный тест
	ПР			1	7		Итоговое тестирование
	Лек	Тема 2. Системы обеспечения и методический инструментарий управления рисками инновационной деятельности предприятия		1	5		Промежуточный тест
	ПР			1	9		Задание 1 Итоговое тестирование
	Лек	Тема 3. Управление операционными, проектными и инвестиционными рисками инновационной деятельности		1	7		Промежуточный тест
	ПР			1	7		Задание 2 Итоговое тестирование
	Лек	Тема 4. Основные механизмы нейтрализации рисков инновационной деятельности предприятия		1	9		Промежуточный тест
	ПР			1	9		Задание 3 Итоговое тестирование
	СР			96	40	-	
	ПА			0,25	-	-	
	Контроль			3,75	-	-	
	Итого:				108	-	

5. Образовательные технологии

В рамках изучения дисциплины «Риски в инновационной деятельности» предусмотрено использование дистанционных образовательных технологий.

6. Методические указания по освоению дисциплины

При подготовке к ответам на тесты по темам курса и выполнению заданий студенту необходимо тщательно изучить электронный учебник по дисциплине, предлагаемую литературу, дополнительные материалы.

Студент самостоятельно работает с дополнительной и основной литературой, Интернет-ресурсами.

7. Оценочные средства

7.1. Паспорт оценочных средств

Семестр	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
4	ПК-2	Вопросы к зачету 1-40, Задание 1-3, Промежуточный тест Итоговое тестирование

7.2. Типовые задания или иные материалы, необходимые для текущего контроля

7.2.1. Примерные тесты к Промежуточному тесту и итоговому тестированию

Задание №1		
Пределы финансового риска со средним уровнем вероятности реализации –		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
)		от 0 до 5%
)		от 10 до 25 %
)		от 5 до 25 %
)		от 25 до 50 %

Задание №2		
По уровню возможных финансовых потерь риски делятся		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
)		на допустимый и критический
)		на критический и катастрофический
)		на допустимый и катастрофический
)		на допустимый, критический и катастрофический

Задание №3		
По возможности предвидения финансовые риски делятся		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
)		на страхуемый и нестрахуемый
)		на прогнозируемый и непрогнозируемый
)		на временный и постоянный
)		на индивидуальный и портфельный

Задание №4		
Такая характеристика риска, как альтернативность выбора, означает, что		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
<input type="radio"/>		финансовый риск предполагает потребность выбора альтернативы действий финансового менеджера
<input type="radio"/>		действие осуществляется финансовым менеджером в условиях ситуации неопределенности или рискованной ситуации при наличии вариантов этого выбора
<input type="radio"/>		риск сопровождает практически все виды финансовых операций и все направления финансовой деятельности компании
<input type="radio"/>		финансовый риск проявляется в сфере экономической деятельности компании

Задание №5		
Какой из видов риска связан с понесением финансовых потерь из-за неблагоприятных изменений ценовых индексов на активы, которые обращаются на финансовом рынке?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
<input type="radio"/>		Ценовой риск
<input type="radio"/>		Валютный риск
<input type="radio"/>		Кредитный риск
<input type="radio"/>		Депозитный риск

Задание №6		
Коммерческий риск – это риск, возникающий		
Выберите несколько из 4 вариантов ответа:		
<input type="checkbox"/>		на коммерческих предприятиях
<input type="checkbox"/>		при заключении коммерческих сделок
<input type="checkbox"/>		в процессе реализации товаров или услуг
<input type="checkbox"/>		в процессе производства товаров или услуг

Задание №7		
Главной функцией риск-менеджмента является		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
<input type="radio"/>		создание чуткой системы управления рисками
<input type="radio"/>		оценка риска по каждому проекту в компании
<input type="radio"/>		оценка риска для компании в целом

<input type="radio"/>		предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий
-----------------------	--	--

Задание №8		
Что является критерием зоны катастрофического риска?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
<input type="radio"/>		Критерий возможности потерь по финансовой операции в размере существенной части или всего собственного капитала
<input type="radio"/>		Критерий возможности потерь по рассматриваемой финансовой операции в размере суммы прибыли
<input type="radio"/>		Критерий возможности потерь по рассматриваемой финансовой операции в размере суммы выручки
<input type="radio"/>		Критерий возможности потерь по рассматриваемой финансовой операции в размере инвестиционного портфеля

Задание №9		
К мониторингу финансовых рисков не относится		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
<input type="radio"/>		мониторинг факторов, которые генерируют финансовые риски
<input type="radio"/>		мониторинг мер в направлении нейтрализации возможных потерь и негативных последствий финансовых рисков
<input type="radio"/>		мониторинг бюджета затрат, который связан с управлением финансовыми рисками
<input type="radio"/>		мониторинг информационного обеспечения управления финансовым процессом

Задание №10		
Корректировка при необходимости отдельных целей и показателей риск-менеджмента происходит в связи с изменением		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
<input type="radio"/>		внутренних условий осуществления хозяйственной деятельности предприятия
<input type="radio"/>		внешней финансовой среды
<input type="radio"/>		конъюнктуры финансового рынка
<input type="radio"/>		внутренних условий осуществления хозяйственной деятельности предприятия, внешней финансовой среды, конъюнктуры финансового рынка

Задание №11		
Своевременность операций контроллинга заключается		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		

)		в адекватности периодов контрольных и корректирующих действий периоду осуществления отдельных операций
)		в периодичности осуществления отдельных операций
)		в частоте осуществления контрольных функций
)		в динамичности системы контроллинга

Задание №12

Последующим после этапа формирования системы приоритетов контролируемых показателей является

Выберите один из 4 вариантов ответа:

)		выбор объекта управления
)		этап разработки системы количественных стандартов контроля
)		выбор субъекта управления
)		выбор предмета управления

Задание №13

Основными контрольными периодами для стратегического контроллинга на предприятии являются

Выберите один из 4 вариантов ответа:

)		день, неделя
)		квартал, год
)		неделя, месяц
)		день, месяц

Задание №14

Укажите правильное утверждение о соотношении риска и дохода при инвестировании на финансовом рынке.

Выберите один из 4 вариантов ответа:

)		Чем ниже риск, тем выше ожидаемый доход
)		Чем выше риск, тем выше ожидаемый доход
)		Чем выше доход, тем ниже предполагаемый риск
)		Риск и доход не связаны между собой

Задание №15

Оценка уровня риска отдельных финансовых инструментов инвестирования осуществляется посредством расчета

Выберите несколько из 4 вариантов ответа:

--	--	--

)		стандартного отклонения, дисперсии
)		средней ожидаемой доходности
)		коэффициента вариации
)		коэффициента корреляции

Задание №16

Коэффициент корреляции доходности по двум финансовым инструментам инвестирования может принимать значения

Выберите один из 4 вариантов ответа:

)		от 0 до +1
)		от –1 до 0
)		от –1 до +1
)		от 0 до бесконечности

Задание №17

Диверсификация портфеля финансовых инструментов инвестирования достигается путём

Выберите один из 4 вариантов ответа:

)		включения в инвестиционный портфель инструментов с отрицательной взаимной корреляцией
)		включения в инвестиционный портфель инструментов с положительной взаимной корреляцией
)		включения в инвестиционный портфель высоколиквидных инструментов
)		включения в инвестиционный портфель инструментов с наиболее высоким уровнем доходности

Задание №18

Расположите в правильном порядке этапы процесса оценки рисков отдельных финансовых инструментов инвестирования.

Укажите порядок следования всех 6 вариантов ответа:

)		Определение величины возможных финансовых потерь при наступлении некоторых рисков событий по отдельным финансовым инструментам инвестирования
)		Идентификация отдельных видов рисков по каждому рассматриваемому финансовому инструменту инвестирования
)		Оценка вероятности наступления рисков состояния по отдельным видам рисков финансового инструмента инвестирования
)		Сопоставление уровня систематического риска отдельных финансовых инструментов инвестирования с ожидаемым уровнем доходности по ним
)		Оценка общего уровня риска отдельных финансовых инструментов с подразделением риска на систематический и несистематический
)		Расположение финансовых инструментов инвестирования по уровню риска

Задание №19

_____ – это снижение участия или полный отказ фирмы от участия в покрытии убытков за счет перекладывания своего риска на третье лицо (обычно страховую компанию) за определенную плату.		
Запишите ответ:		
)	Ответ:	

Задание №20		
В каких формах может проявляться избежание рисков?		
Выберите несколько из 5 вариантов ответа:		
)		Отказ от осуществления операций с высоким уровнем риска
)		Отказ от продолжения отношений с партнерами, которые часто нарушают свои обязательства
)		Отказ от использования в высоких объемах заемного капитала
)		Передача риска страховой компании
)		Заключение сделки на рынке деривативов

Критерии оценки:

Формы текущего контроля	Условия допуска	Критерии и нормы оценки
Промежуточный тест	Отсутствуют	Максимальное количество баллов – 44 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Итоговое тестирование	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 40 б. (система выдаёт 30 случайных вопросов из банка тестовых заданий; баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)

7.2.2. Практические задания

Задание 1

К теме 1 «Сущность, цель и функции управления рисками инновационной деятельности предприятия»

Раскройте содержание каждого из классификационных признаков финансовых рисков, представленных ниже.

п/п	Вид финансового риска	Содержание финансового риска в инновационной деятельности
	Валютный риск	
	Ценовой риск	

	Риск снижения финансовой устойчивости компании	
	Кредитный риск	
	Инвестиционный риск	
	Депозитный риск	
	Инновационный риск	

Задание 2

К теме 2 «Сущность, цель и функции управления рисками инновационной деятельности предприятия»

Напишите эссе на тему: «Финансовые риски предприятия в инновационной деятельности»

Рекомендации. При написании эссе проведите краткий обзор различных видов финансовых рисков в инновационной деятельности.

Задание 3

К теме 2 «Системы обеспечения и методический инструментарий управления рисками инновационной деятельности предприятия»

Раскройте содержание каждой из систем обеспечения управления финансовыми рисками предприятия, представленных ниже.

п/п	Вид системы обеспечения управления финансовыми рисками	Характеристика системы обеспечения управления финансовыми рисками
	Риск-анализ	
	Риск-контроллинг	
	Риск-планирование	
	Система информационного обеспечения	

7.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

7.3.1. Вопросы к промежуточной аттестации

Семестр 4

№ п/п	Вопросы к зачету
1	Теоретические и практические подходы к определению риска: достоинства и недостатки.
2	Рисковые ситуации: понятия и стадии развития жизненного цикла. Практическое значение.
3	Жизненный цикл: типовые сценарии динамики жизненного цикла. Оптимистический, реалистический и пессимистический сценарий развития.
4	Жизненный цикл управления рисками: понятие, функции и этапы.
5	Классификации рисков инновационной деятельности. Приведите примеры проявления рисков инновационной деятельности по видам: чистые (статические) и спекулятивные (динамические); систематические (недиверсифицируемые) и систематические; внутренние и внешние; функциональные.
6	Цели и задачи анализа рисков инновационной деятельности.
7	Разработки формальной модели риска инновационной деятельности. Как можно представить формальную модель риска инновационной деятельности.
8	Основные аналитические параметры и показатели риска. Преимущества и недостатки количественных показателей риска. Преимущества и недостатки качественных показателей?
9	Количественные методы оценки рисков.
10	Качественные методы оценки рисков.
11	Методы экспертных оценок: понятие, преимущества и ограничения.
12	Значение SWOT-анализа в инновационной деятельности. Значение метода Дельфи.
13	Методика качественной оценки проектных рисков.
14	Метод сценарный анализ: содержание и область применения.
15	Графические методы оценки рисков. Какие виды графиков используются в техническом анализе рисков? Особенности их применения.
16	Что понимается под трендом, линией поддержки и линией сопротивления? Зачем они строятся?
17	Фундаментальный и технический анализ рисков.
18	Основные принципы управления рисками инновационной деятельности.
19	Диверсификация: понятие и виды. Условия эффективности применения методов диверсификации при управлении рисками.
20	Страхование в управление рисками: содержание и формы. Оцените страхование рисков в экономически развитых странах и России.
21	Компенсация в управление рисками: содержание и формы. Оцените компенсацию рисков инновационной деятельности в экономически развитых странах и России.
22	Распределение в управление рисками: содержание и формы. Оцените распределение рисков в экономически развитых странах и России.
23	Локализация в управление рисками: содержание и формы. Основные направления локализации рисков.
24	Хеджирование в управление рисками: содержание и формы. Оцените хеджирование рисков в экономически развитых странах и России.
25	Система управления рисками. Преимущества и недостатки централизованной и децентрализованной системы управления рисками.
26	Выбор стратегии управления рисками. Кривые безразличия и их влияние на стратегию управления рисками.

27	Критерии эффективности управления рисками. Факторы эффективности определяют ее уровень.
28	Рисковое предпринимательство: понятие, значение и виды. Функции рискованного предпринимательства в инновационной деятельности.
29	Венчурный капитал и механизм его формирования. Организация управления рискоинвестициями.
30	Характеристика риска как объекта финансового управления предприятием
31	Классификация финансовых рисков предприятия
32	Сущность, цель и задачи управления финансовыми рисками предприятия
33	Содержание процесса управления финансовыми рисками предприятия
34	Система информационного обеспечения управления финансовыми рисками предприятия
35	Объективное и субъективное понимание риска
36	Структурная характеристика риска, экономические и предпринимательские риски
37	Методический инструментальный оценки финансового риска
38	Специфические классификации рисков
39	Развитие взглядов на управление риском
40	Понятие и общая характеристика системы управления рисками

7.3.2. Критерии и нормы оценки

Формы текущего контроля	Условия допуска	Критерии и нормы оценки
Задание 1	Отсутствуют	4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 2	Отсутствуют	5 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2-3 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балл – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 3	Отсутствуют	4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Промежуточный тест	Отсутствуют	Максимальное количество баллов – 44 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Заполненная анкета	Отсутствуют	3 балла – анкета заполнена 0 – анкета не заполнена
Итоговое тестирование	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 40 б. (система выдаёт 30 случайных вопросов из банка тестовых заданий; баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Итого		Максимальное количество баллов – 100 б.

7.3.2. Критерии и нормы оценки

Семестр	Форма проведения промежуточной аттестации	Критерии и нормы оценки	
4	Зачет	«зачтено»	Студент набрал свыше 55 баллов по накопительному рейтингу
		«не зачтено»	Студент набрал 54 и менее баллов по накопительному рейтингу

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

8.1. Обязательная литература

№ п/п	Авторы, составители	Заглавие (заголовок)	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, др.)	Год издания	Количество в научной библиотеке / Наименование ЭБС
1.	Балдин, К. В.	Управление рисками	учеб. пособие	2020	ЭБС «IPRbooks»
2.	Балдин, К. В., Передеряев И.И., Голов Р.С.	Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия	учеб. пособие	2019	ЭБС «IPRbooks»
3.	Черняева С.Н., Коробова Л.А., Толстова И.С.	Управление рисками.	Практикум	2022	ЭБС «IPRbooks»

8.2. Дополнительная литература

№ п/п	Авторы, составители	Заглавие (заголовок)	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, др.)	Год издания	Количество в научной библиотеке / Наименование ЭБС
1.	Касаткин Б.П.	Концептуальные основы и практика управления рисками в промышленном предпринимательстве.	Монография (книга)	2020	ЭБС «IPRbooks»
2.	Канев В.С.,	Теоретические основы управления рисками	Учебное пособие	2020	ЭБС «IPRbooks»

8.3. Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем

— WebofScience[Электронный ресурс] : мультидисциплинарная реферативная база данных. – Philadelphia: ClarivateAnalytics, 2016– . – Режим доступа : apps.webofknowledge.com. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

— Scopus[Электронный ресурс] : реферативная база данных. – Netherlands: Elsevier, 2004– . – Режим доступа : scopus.com. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

— Elibrary[Электронный ресурс] : научная электронная библиотека. – Москва : НЭБ, 2000– . – Режим доступа : elibrary.ru. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

— SpringerLink[Электронный ресурс] : [база данных]. – Switzerland: SpringerNature, 1842– . – Режим доступа : link.springer.com. – Загл. с экрана. – Яз. англ.

— ScienceDirect[Электронный ресурс] : коллекция электронных книг издательства Elsevier. – Netherlands: Elsevier, 2018– . – Режим доступа : sciencedirect.com. – Загл. с экрана. – Яз. англ.

— Cambridgeuniversitypress[Электронный ресурс] : журналы издательства. – Cambridge: Cambridgeuniversitypress, 2018– . – Режим доступа : cambridge.org. – Загл. с экрана. – Яз. англ.

— NEICON[Электронный ресурс] : электронная информация : архив научных журналов. – Москва : НЭИКОH, 2002– . – Режим доступа : neicon.ru/resources/archive. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

8.4. Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование ПО	Реквизиты договора (дата, номер, срок действия)
1	Windows: WinPro 10 RUS Upgrd OLP NL Acdmc	договор № 757 от 04.07.2018, срок действия – бессрочно; контракт № 1653 от 14.12.2018, срок действия – бессрочно
2	Office Standard:	
	Office Stdandard 2013 Russian OLP NL AcademicEdition	контракт № 690 от 19.05.2015, срок действия – бессрочно
	Office Stdandard 2016 Russian OLP NL AcademicEdition	договор № 757 от 04.07.2018, срок действия – бессрочно; контракт № 727 от 20.07.2016, срок действия – бессрочно
3	Mirapolis Human Capital Management	лицензионный договор № 614 от 20.06.2023, срок до 31.12.2023 включительно

8.5. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий, помещений для самостоятельной работы обучающихся (номер аудитории)	Перечень основного оборудования
1.	Аудитория веб-конференций. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа.	Экран телевизионный, ширмы, проектор на штативе. стол преподавательский, стулья преподавательские., транспарант-

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий, помещений для самостоятельной работы обучающихся (номер аудитории)	Перечень основного оборудования
	Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации. (С-409)	перетяжка, системный блок .
2.	Помещение для самостоятельной работы обучающихся (С-916)	Компьютеры, столы, стулья