МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Магнитогорский государственный технический университет им. Г.И. Носова»

УТВЕРЖДАЮ
Директор ИЭиУ
_____ Н.Р. Балынская

10.03.2021 г.

ПРОГРАММА

ГОСУДАРСТВЕННОЙ ИТОГОВОЙ АТТЕСТАЦИИ

Направление подготовки
38.04.01 ЭКОНОМИКА

Направленность (профиль/специализация) программы
Финансовые технологии и управление рисками в бизнесе

Уровень высшего образования - магистратура
Программа подготовки – академическая магистратура

Форма обучения
очная

Институт/ факультет	Институт экономики и управления
Кафедра	Экономики
Курс	2
Семестр	4

Магнитогорск
2021 год

Программа государственной итоговой аттестации составлена на основе ФГОС ВО - магистратура по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 11.08.2020 г. № 939)

Программа государственной итоговой аттестации рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Экономики 11.02.2021, протокол № 6

Зав. кафедрой _____ А.Г. Васильева

Программа государственной итоговой аттестации одобрена методической комиссией ИЭиУ 10.03.2021 г. протокол № 3

Председатель _____ Н.Р. Балынская

Программа ГИА составлена:

доцент кафедры Экономики, канд. пед. наук _____Н.Н.Костина

Рецензент:
заместитель директора по учебной работе, заведующий кафедрой экономики Сибайского института (филиала) ФГБОУ ВО «Башкирский государственный университет», д-р экон. наук, доцент,

_____И.А. Ситнова

Лист актуализации рабочей программы

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для реализации в 2022 - 2023 учебном году на заседании кафедры Экономики

Протокол от __ _____ 20__ г. № __
Зав. кафедрой _____ А.Г. Васильева

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для реализации в 2023 - 2024 учебном году на заседании кафедры Экономики

Протокол от __ _____ 20__ г. № __
Зав. кафедрой _____ А.Г. Васильева

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для реализации в 2024 - 2025 учебном году на заседании кафедры Экономики

Протокол от __ _____ 20__ г. № __
Зав. кафедрой _____ А.Г. Васильева

1 Общие положения

Государственная итоговая аттестация проводится государственными экзаменационными комиссиями в целях определения соответствия результатов освоения обучающимися образовательных программ соответствующим требованиям федерального государственного образовательного стандарта.

Магистр по направлению подготовки 38.04.01 Экономика должен быть подготовлен к решению профессиональных задач в соответствии с направленностью (профилем) образовательной программы «Финансовые технологии и управление рисками в бизнесе» и видам профессиональной деятельности:

1) научно-исследовательская деятельность:

- разработка рабочих планов и программ проведения научных исследований и разработок, подготовка заданий для групп и отдельных исполнителей;
- разработка инструментария проводимых исследований, анализ их результатов;
- подготовка данных для составления обзоров, отчетов и научных публикаций;
- сбор, обработка, анализ и систематизация информации по теме исследования, выбор методов и средств решения задач исследования;
- организация и проведение научных исследований, в том числе статистических обследований и опросов;
- разработка теоретических и эконометрических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к сфере профессиональной деятельности, оценка и интерпретация полученных результатов;

2) проектно-экономическая деятельность:

- подготовка заданий и разработка проектных решений с учетом фактора неопределенности;
- подготовка заданий и разработка методических и нормативных документов, а также предложений и мероприятий по реализации разработанных проектов и программ;
- подготовка заданий и разработка системы социально-экономических показателей хозяйствующих субъектов;
- составление экономических разделов планов предприятий и организаций различных форм собственности;
- разработка стратегии поведения экономических агентов на различных рынках;

3) аналитическая деятельность:

- разработка и обоснование социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов, и методик их рас-
  чета;
- поиск, анализ и оценка источников информации для проведения экономических расчетов;
- проведение оценки эффективности проектов с учетом фактора неопределенности;
- анализ существующих форм организации управления; разработка и обоснование предложений по их совершенствованию;
- прогнозирование динамики основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом;

4) организационно-управленческая деятельность:

- организация творческих коллективов для решения экономических и социальных задач и руководство ими;

- разработка стратегий развития и функционирования предприятий, организаций и их отдельных подразделений;
- руководство экономическими службами и подразделениями предприятий и организаций разных форм собственности, органов государственной и муниципальной власти;

В соответствии с видами и задачами профессиональной деятельности выпускник на государственной итоговой аттестации должен показать соответствующий уровень освоения следующих компетенций:

- Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий (УК-1);
- Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла (УК-2);
- Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели (УК-3);
- Способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия (УК-4);
- Способен анализировать и учитывать разнообразие культур в процессе межкультурного взаимодействия (УК-5);
- Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки (УК-6);
- Способен применять знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач (ОПК-1);
- Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях (ОПК-2);
- Способен обобщать и критически оценивать научные исследования в экономике (ОПК-3);
- Способен принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность (ОПК-4);
- Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач (ОПК-5);
- Способен проводить исследования и анализ в сфере финансовых технологий и управления рисками (ПК-1);
- Способен проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой (ПК-2);
- Способен управлять процессом финансового консультирования в организации (ПК-3);
- Способен самостоятельно проектировать новые продукты и бизнес-модели в сфере финансовых технологий с учетом фактора неопределенности (ПК-4);
- Способен строить интегрированные системы управления рисками организации (ПК-5);
- Способен методически обеспечивать, поддерживать и координировать процесс управления рисками (ПК-6).

На основании решения Ученого совета университета от 17.03.2021 г. (протокол № 5) государственные аттестационные испытания по направлению подготовки 38.04.01 Экономика проводятся в форме:

- государственного экзамена;
- защиты выпускной квалификационной работы.

К государственной итоговой аттестации допускается обучающийся, не имеющий академической задолженности и в полном объеме выполнивший учебный план или индивидуальный учебный план по данной образовательной программе.

2. Программа и порядок проведения государственного экзамена

Согласно учебному плану подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена проводится в период с 02.06.2023 г. по 16.06.2023 г. для очной формы обучения. Для проведения государственного экзамена составляется расписание экзамена и предэкзаменационной консультации (консультирование обучающихся по вопросам, включенным в программу государственного экзамена).

Государственный экзамен проводится на открытых заседаниях государственной экзаменационной комиссии в специально подготовленных аудиториях, выведенных на время экзамена из расписания. Присутствие на государственном экзамене посторонних лиц допускается только с разрешения председателя ГЭК.

Обучающимся и лицам, привлекаемым к государственной итоговой аттестации, во время ее проведения запрещается иметь при себе и использовать средства оперативной и мобильной связи.

Государственный экзамен проводится в устной форме.

Государственный экзамен включает два теоретических вопроса и одно практическое задание. Продолжительность экзамена составляет 30 мин. на каждого экзаменуемого.

Во время государственного экзамена студент может пользоваться программой ГИА, нормативной и справочной литературой.

После устного ответа на вопросы экзаменационного билета экзаменуемому могут быть предложены дополнительные вопросы в пределах учебного материала, вынесенного на государственный экзамен.

Результаты государственного экзамена определяются оценками: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно» и объявляются в день приема экзамена.

Критерии оценки государственного экзамена:

– на оценку **«отлично»** (5 баллов) – обучающийся должен показать высокий уровень сформированности компетенций, т.е. показать способность обобщать и оценивать информацию, полученную на основе исследования нестандартной ситуации; использовать сведения из различных источников; выносить оценки и критические суждения, основанные на прочных знаниях;

– на оценку **«хорошо»** (4 балла) – обучающийся должен показать продвинутый уровень сформированности компетенций, т.е. продемонстрировать глубокие прочные знания и развитые практические умения и навыки, умение сравнивать, оценивать и выбирать методы решения заданий, работать целенаправленно, используя связанные

между собой формы представления информации;

– на оценку **«удовлетворительно»** (3 балла) – обучающийся должен показать базовый уровень сформированности компетенций, т.е. показать знания на уровне воспроизведения и объяснения информации, профессиональные, интеллектуальные навыки решения стандартных задач.

–на оценку **«неудовлетворительно»** (2 балла) – обучающийся не обладает необходимой системой знаний, допускает существенные ошибки, не может показать интеллектуальные навыки решения простых задач.

– на оценку **«неудовлетворительно»** (1 балл) – обучающийся не может показать знания на уровне воспроизведения и объяснения информации, не может показать интеллектуальные навыки решения простых задач.

Результаты государственного экзамена объявляются в день его проведения.

Обучающийся, успешно сдавший государственный экзамен, допускается к выполнению и защите выпускной квалификационной работы.

2.1 Содержание государственного экзамена

2.1.1 Перечень теоретических вопросов, выносимых на государственный экзамен

1. Понятие риска, его сущность и содержание. Определение риска как экономической категории. Аксиомы и постулаты рискологии.
2. Классификации рисков. Финансовые риски и методы их оценки.
3. Классификации рисков. Маркетинговые риски и методы их оценки.
4. Классификации рисков. Производственные риски и методы их оценки.
5. Классификации рисков. Логистические риски и методы их оценки.
6. Классификации рисков. Инновационные риски и методы их оценки.
7. Классификации рисков. Информационные риски и методы их оценки.
8. Классификации рисков. Технические риски и методы их оценки.
9. Классификации рисков. Технологические риски и методы их оценки.
10. Классификации рисков. Валютные риски и методы их оценки.
11. Классификации рисков. Организационные риски и методы их оценки.
12. Классификации рисков. Управленческие риски и методы их оценки.
13. Риск и неопределенность. Неопределенность как источник риска. Возможности теории хаоса и теории бифуркаций в описании риска.
14. Риск как случайное и закономерное явление, вероятность и возможность. Описание рисков на основе марковских и немарковских процессов.
15. Концепции риска в исследованиях Н. Лумана, Э. Гидденса, У Бека.
16. Концепция приемлемого риска в исследованиях Т. Бартона, Р.М. Качалова, П. Уокера.
17. Теоретические источники управления риском. Теория вероятностей и математическая статистика.
18. Теоретические источники управления риском. Нечетко-множественные описания рисков.
19. Основы негэнтропийного подхода в управлении риском. Необходимость ввода негэнтропии в условиях реализации инновационной стратегии.
20. Управление риском в современной теории менеджмента. Риск-менеджмент как подсистема финансового менеджмента организации.
21. Современная парадигма риск-менеджмента организаций. Интегрированный, непрерывный, расширенный риск-менеджмент.
22. Системный подход в риск-менеджменте и комплекс мер по его реализации.
23. Роль функционального контроллинга в риск-менеджменте.

24. Организация риск-менеджмента на предприятии, взаимосвязь со стратегией и контроль процесса управления рисками.
25. Идентификация рисковой ситуации в организации и карты рисков.
26. Исследование возможностей использования гибридной информации в системе планирования и управления риском.
27. Использование методов теории игр для исследования уровня риска и выбора стратегии финансирования сбытовой деятельности.
28. Использование методов анализа чувствительности для оценки уровня рисков и выявления значимых факторов управления риском.
29. Использование метода анализа сценариев для оценки и анализа рисков проектно-внедренческой деятельности.
30. Использование метода дерева решения для оценки рисков инвестиционных проектов по каждому сценарию их развития.
31. Использование методов экспертных оценок для идентификации, оценки и анализа рисков. Порядок экспертных исследований на основе Дельфийского метода.
32. Статистические методы в оценке уровня риска. Возможности использования статистических методов в рамках предстраховой экспертизы.
33. Использование метода аналогий для идентификации и оценки уровня рисков. Возможности оценки вероятности потерь в результате принятия управленческих решений.
34. Использование метода ставки процента с поправкой на риск: достоинства и недостатки, практика использования в инвестиционном проектировании.
35. Использование метода критических значений для оценки уровня риска в условиях формирования программы производства и реализации продукции.
36. Возможности применения методов портфельной теории для анализа и управления рисками.
37. Использование аппарата теории нечетких множеств для оценки уровня рисков.
38. Идентификация, оценка и возможности оптимизации вторичных рисков.
39. Страхование как метод управления рисками организации.
40. Хеджирование как метод управления рисками организации.
41. Резервирование как метод управления рисками организации.
42. Методика и алгоритм оценки риска на основе трехкомпонентного показателя финансовой ситуации в организации.
43. Антикризисное управление в организации с учетом факторов риска.
44. Основы актуарных расчетов в страховании.
45. Пути повышения конкурентоспособности отечественных страховых компаний.
46. Основы методики построения страховых тарифов имущественных рисков.
47. Методы оценки ущербов и процедура урегулирования убытков в страховании.
48. Экономическая сущность и основные процедуры сострахования и перестрахования, роль страховых пулов.
49. Методы и алгоритмы оценки финансовой устойчивости страховой компании.
50. Особенности формирования и размещения страховых резервов на финансовых рынках в деятельности страховых компаний.

2.1.2 Перечень практических заданий, выносимых на государственный экзамен

Задача № 1.

На основе использования современных методов финансового и факторного анализа выявить ключевые факторы стратегического риска и оценить уровень капитализации промышленной компании по показателю темпа роста собственного капитала компании.

Исходная информация для расчетов представлена в Приложении 1 и характеризует состояние активов и пассивов компании, ее прибыль по состоянию на конец 2019 и 2020 гг.

Задача № 2.

На основе использования современных методов финансового и факторного анализа выявить ключевые факторы тактического риска и оценить уровень капитализации промышленной компании по показателю темпа роста собственного капитала компании.

Исходная информация для расчетов представлена в Приложении 2 и характеризует состояние активов и пассивов компании, ее прибыль по состоянию на конец 2019 и 2020 гг.

Задача № 3.

Компания использует несколько каналов сбыта продукции определенного ассортимента на внутреннем рынке. На основе анализа маркетинговых исследований рынка были обобщены следующие сведения:

- прогнозный годовой объем сбыта продукции с гарантированным, устойчивым уровнем сбыта на ряд лет (с низкой зависимостью от резких изменений рыночной конъюнктуры) W_1 = 4000 млн. руб.;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции с устойчивым уровнем сбыта на ближайший год, не на длительный срок (средняя зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_2 = 6000 млн. руб.;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции, обеспечиваемый только разовыми поставками (высокая зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_3 = 10000 млн. руб.;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции, покупатель на которую строго не определен (абсолютная зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_4 = 13000 млн. руб..

Таким образом, общий прогнозный годовой объем сбыта определенной продукции рассматриваемого предприятия, основанный на маркетинговом анализе конъюнктуры рынка, составляет $\Sigma W_j = W_1 + W_2 + W_3 + W_4$.

В рамках маркетинговых исследований также определены четыре стратегии производства и реализации той же продукции в условиях предприятия:

- стратегия сбыта S_1 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 5000 млн. рублей;
- стратегия сбыта S_2 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 8000 млн. рублей;
- стратегия сбыта S_3 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 11000 млн. рублей;
- стратегия сбыта S_4 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 13000 млн. рублей.

Все необходимые данные по всем W_j и S_i представлены в Приложении 3.

Используя методы теории игр, результаты расчетов риска по критерию Вальда, обосновать выбор стратегии финансирования сбыта компании в задаваемых условиях конъюнктуры рынка.

Задача № 4.

Компания использует несколько каналов сбыта продукции определенного ассортимента на внутреннем рынке. На основе анализа маркетинговых исследований рынка были обобщены следующие сведения:

- прогнозный годовой объем сбыта продукции с гарантированным, устойчивым уровнем сбыта на ряд лет (с низкой зависимостью от резких изменений рыночной конъюнктуры) W_1 = 4000 млн. руб.;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции с устойчивым уровнем сбыта на ближайший год, не на длительный срок (средняя зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_2 = 6000 млн. руб.;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции, обеспечиваемый только разовыми поставками (высокая зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_3 = 10000 млн. руб.;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции, покупатель на которую строго не определен (абсолютная зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_4 = 13000 млн. руб.

Таким образом, общий прогнозный годовой объем сбыта определенной продукции рассматриваемого предприятия, основанный на маркетинговом анализе конъюнктуры рынка, составляет $\Sigma W_j = W_1 + W_2 + W_3 + W_4$.

В рамках маркетинговых исследований также определены четыре стратегии производства и реализации той же продукции в условиях предприятия:

- стратегия сбыта S_1 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 4000 млн. рублей;
- стратегия сбыта S_2 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 7000 млн. рублей;
- стратегия сбыта S_3 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 10000 млн. рублей;
- стратегия сбыта S_4 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 13000 млн. рублей.

Все необходимые данные по всем W_j и S_i представлены в Приложении 4.

Используя методы теории игр, результаты расчетов по критерию Сэвиджа, обосновать выбор стратегии финансирования сбыта компании в задаваемых условиях конъюнктуры рынка.

Задача № 5.

Компания использует несколько каналов сбыта продукции определенного ассортимента на внутреннем рынке. На основе анализа маркетинговых исследований рынка были обобщены следующие сведения:

- прогнозный годовой объем сбыта продукции с гарантированным, устойчивым уровнем сбыта на ряд лет (с низкой зависимостью от резких изменений рыночной конъюнктуры) W_1 = 4000 млн. руб.;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции с устойчивым уровнем сбыта на ближайший год, не на длительный срок (средняя зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_2 = 6000 млн. руб.;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции, обеспечиваемый только разовыми поставками (высокая зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_3 = 10000 млн. руб.;

- прогнозный годовой объем сбыта продукции, покупатель на которую строго не определен (абсолютная зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_4 = 13000 млн. руб..

Таким образом, общий прогнозный годовой объем сбыта определенной продукции рассматриваемого предприятия, основанный на маркетинговом анализе конъюнктуры рынка, составляет $\Sigma W_j = W_1 + W_2 + W_3 + W_4$.

В рамках маркетинговых исследований также определены четыре стратегии производства и реализации той же продукции в условиях предприятия:

- стратегия сбыта S_1 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 3000 млн. рублей;
- стратегия сбыта S_2 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 6000 млн. рублей;
- стратегия сбыта S_3 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 11000 млн. рублей;
- стратегия сбыта S_4 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 13000 млн. рублей.

Все необходимые данные по всем W_j и S_i представлены в Приложении 5.

Используя методы теории игр, результаты расчетов риска по критерию Гурвица (коэффициент оптимизма-пессимизма 0,8) обосновать выбор стратегии финансирования сбыта компании в задаваемых условиях конъюнктуры рынка.

Задача № 6.

Компания использует несколько каналов сбыта продукции определенного ассортимента на внутреннем рынке. На основе анализа маркетинговых исследований рынка были обобщены следующие сведения:

прогнозный годовой объем сбыта продукции с гарантированным, устойчивым уровнем сбыта на ряд лет (с низкой зависимостью от резких изменений рыночной конъюнктуры) W_1 = 4000 млн. руб.;

прогнозный годовой объем сбыта продукции с устойчивым уровнем сбыта на ближайший год, не на длительный срок (средняя зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_2 = 6000 млн. руб.;

прогнозный годовой объем сбыта продукции, обеспечиваемый только разовыми поставками (высокая зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_3 = 10000 млн. руб.;

прогнозный годовой объем сбыта продукции, покупатель на которую строго не определен (абсолютная зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_4 = 13000 млн. руб..

Таким образом, общий прогнозный годовой объем сбыта определенной продукции рассматриваемого предприятия, основанный на маркетинговом анализе конъюнктуры рынка, составляет $\Sigma W_j = W_1 + W_2 + W_3 + W_4$.

В рамках маркетинговых исследований также определены четыре стратегии производства и реализации той же продукции в условиях предприятия:

стратегия сбыта S_1 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 5000 млн. рублей;

стратегия сбыта S_2 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 8000 млн. рублей;

стратегия сбыта S_3 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 11000 млн. рублей;

стратегия сбыта S_4 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом 13000 млн. рублей.

Все необходимые данные по всем W_j и S_i представлены Приложении 6.

Используя методы теории игр, результаты расчетов риска по критерию Гурвица (коэффициент оптимизма-пессимизма 0,2) обосновать выбор стратегии финансирования сбыта компании в задаваемых условиях конъюнктуры рынка.

Задача № 7.

Провести экспертное исследование с идентификацией и оценкой факторов риска в условиях ИТ-проекта. Для систематизации и оценки результатов экспертного исследования применить Дельфийский метод. Идентифицировать и систематизировать факторы, оказывающие влияние на уровень риска ИТ-проекта. При этом рассматриваются следующие факторы: $X1$ - качество программного обеспечения; $X2$ - сроки выполнения проекта; $X3$ - объем инвестиционных затрат; $X4$ - качество аутсорсинга; $X5$ - уровень рыночной конъюнктуры.

В эксперименте принимают участие 7 независимых экспертов, в их задачу входит определение ранга каждого фактора по пятибалльной системе. Наименьший по значению ранг присваивается фактору, оказывающему наибольшее влияние на уровень эффективности рекламы. Оценки экспертов представляются в виде матрицы рангов опроса, в строках которой указываются факторы, а в столбцах – оценки экспертов (результаты опроса экспертов представлены в Приложении 7).

Задача № 8.

Провести экспертное исследование с идентификацией и оценкой факторов риска в условиях ИТ-проекта. Для систематизации и оценки результатов экспертного исследования применить Дельфийский метод. Идентифицировать и систематизировать факторы, оказывающие влияние на уровень риска ИТ-проекта. При этом рассматриваются следующие факторы: $X1$ - качество программного обеспечения; $X2$ - сроки выполнения проекта; $X3$ - объем инвестиционных затрат; $X4$ - качество аутсорсинга; $X5$ - уровень рыночной конъюнктуры.

В эксперименте принимают участие 7 независимых экспертов, в их задачу входит определение ранга каждого фактора по пятибалльной системе. Наименьший по значению ранг присваивается фактору, оказывающему наибольшее влияние на уровень эффективности рекламы. Оценки экспертов представляются в виде матрицы рангов опроса, в строках которой указываются факторы, а в столбцах – оценки экспертов (результаты опроса экспертов представлены в Приложении 8).

Задача № 9.

Провести экспертное исследование с идентификацией и оценкой факторов риска в условиях ИТ-проекта. Для систематизации и оценки результатов экспертного исследования применить Дельфийский метод. Идентифицировать и систематизировать факторы, оказывающие влияние на уровень риска ИТ-проекта. При этом рассматриваются следующие факторы: $X1$ - качество программного обеспечения; $X2$ - сроки выполнения проекта; $X3$ - объем инвестиционных затрат; $X4$ - качество аутсорсинга; $X5$ - уровень рыночной конъюнктуры.

В эксперименте принимают участие 7 независимых экспертов, в их задачу входит определение ранга каждого фактора по пятибалльной системе. Наименьший по значению ранг присваивается фактору, оказывающему наибольшее влияние на уровень эффективности рекламы. Оценки экспертов представляются в виде матрицы рангов опроса, в строках которой указываются факторы, а в столбцах – оценки экспертов (результаты опроса экспертов представлены в Приложении 9).

Задача № 10.

Провести экспертное исследование с идентификацией и оценкой факторов риска в условиях ИТ-проекта. Для систематизации и оценки результатов экспертного исследования применить Дельфийский метод. Идентифицировать и систематизировать факторы, оказывающие влияние на уровень риска ИТ-проекта. При этом рассматриваются следующие факторы: $X1$ - качество программного обеспечения; $X2$ - сроки выполнения проекта; $X3$ - объем инвестиционных затрат; $X4$ - качество аутсорсинга; $X5$ - уровень рыночной конъюнктуры.

В эксперименте принимают участие 7 независимых экспертов, в их задачу входит определение ранга каждого фактора по пятибалльной системе. Наименьший по значению ранг присваивается фактору, оказывающему наибольшее влияние на уровень эффективности рекламы. Оценки экспертов представляются в виде матрицы рангов опроса, в строках которой указываются факторы, а в столбцах – оценки экспертов (результаты опроса экспертов представлены в Приложении 10).

Задача № 11.

Провести экспертное исследование с идентификацией и оценкой факторов риска в условиях ИТ-проекта. Для систематизации и оценки результатов экспертного исследования применить Дельфийский метод. Идентифицировать и систематизировать факторы, оказывающие влияние на уровень риска ИТ-проекта. При этом рассматриваются следующие факторы: $X1$ - качество программного обеспечения; $X2$ - сроки выполнения проекта; $X3$ - объем инвестиционных затрат; $X4$ - качество аутсорсинга; $X5$ - уровень рыночной конъюнктуры.

В эксперименте принимают участие 7 независимых экспертов, в их задачу входит определение ранга каждого фактора по пятибалльной системе. Наименьший по значению ранг присваивается фактору, оказывающему наибольшее влияние на уровень эффективности рекламы. Оценки экспертов представляются в виде матрицы рангов опроса, в строках которой указываются факторы, а в столбцах – оценки экспертов (результаты опроса экспертов представлены в Приложении 11).

Задача № 12.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю абсолютной ликвидности.

Исходные данные представлены в Приложении 1.

Задача № 13.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю критической ликвидности (промежуточный коэффициент покрытия).

Исходные данные представлены в Приложении 2.

Задача № 14.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю текущей ликвидности (коэффициент покрытия).

Исходные данные представлены в Приложении 1.

Задача № 15.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю общей платежеспособности.

Исходные данные представлены в Приложении 2.

Задача № 16.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю концентрации собственного капитала (коэффициент автономии).

Исходные данные представлены в Приложении 1.

Задача № 17.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю концентрации заемного капитала.

Исходные данные представлены в Приложении 2.

Задача № 18.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю финансовой зависимости.

Исходные данные представлены в Приложении 1.

Задача № 19.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю (коэффициенту) текущей задолженности.

Исходные данные представлены в Приложении 2.

Задача № 20.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю (коэффициенту) устойчивого финансирования.

Исходные данные представлены в Приложении 1.

Задача № 21.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю (коэффициенту) финансовой независимости капитализированных источников финансирования.

Исходные данные представлены в Приложении 2.

Задача № 22.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю (коэффициенту) финансовой зависимости капитализированных источников финансирования.

Исходные данные представлены в Приложении 1.

Задача № 23.

Используя метод декомпозиции и агрегирования балансовых статей провести оценку и анализ уровня финансового риска компании по показателю финансового левериджа (коэффициенту финансового риска).

Исходные данные представлены в Приложении 2.

Задача № 24.

Используя метод трехкомпонентного показателя финансовой ситуации компании оценить уровень риска инвестиционного проекта строительства цеха по производству комплектующих изделий для автомобильной промышленности на основе нанотехнологий. Необходимые исходные данные для оценки риска инвестиционного проекта представлены в Приложении 12.

Задача № 25.

Используя метод трехкомпонентного показателя финансовой ситуации компании оценить уровень риска инвестиционного проекта модернизации производства. Необходимые исходные данные для оценки риска инвестиционного проекта представлены в Приложении 13.

2.1.3 Учебно-методическое обеспечение

а) Основная литература

1. Годин, А. М. Страхование / Годин А.М., Косов М.Е., Фрумина С.В., - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва :Дашков и К, 2018. - 196 с.: ISBN 978-5-394-02684-3. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/read?id=72917 (дата обращения 11.02.2021 г.)

2. Королев, В. Ю. Математические основы теории риска: Учебное пособие / В.Ю. Королев, В.Е. Бенинг, С.Я. Шоргин. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : ФИЗМАТЛИТ, 2011. - 620 с. (Математика. Прикладная математика). ISBN 978-5-9221-1267-3, 500 экз. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/read?id=20543 (дата обращения 11.02.2021 г.)

б) Дополнительная литература:

1. Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных, А.В. Дадалко, В.В. Земсков, Н.Г. Синявский ; под общ. ред. А.В. Дадалко. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 203 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс; Режим доступа http://new.znanium.com]. — (Высшее образование: Магистратура). — www.dx.doi.org/10.12737/23556. - ISBN 978-5-16-012236-6. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/read?id=340539 (дата обращения 11.02.2021 г.)

2. Управление банковскими рисками в условиях глобализации мировой экономики : науч.-практ. пособие для специалистов / В. В. Рудько-Силиванов, Н . В. Зубрилова, К. В. Лапина, Н. В. Кучина ; под ред. В. В. Ткаченко. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : РИОР : ИНФРА-М, 2012. - 318 с. - (Научная мысль). - ISBN 978-5-369-01120-1 (РИОР), ISBN 978-5-16-006292-1 (ИНФРА-М). - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/read?id=122025 (дата обращения 11.02.2021 г.)

3. Немцев, В. Н. Методология и апробация научных исследований в сфере управления рисками и страхования : учебно-методическое пособие [для вузов] / В. Н. Немцев, М. Г. Абилова, А. В. Дерябин ; Магнитогорский гос. технический ун-т им. Г. И. Носова. - Магнитогорск : МГТУ им. Г. И. Носова, 2019. - 1 CD-ROM. - ISBN 978-5-9967-1687-6. - Загл. с титул. экрана. - URL : https://magtu.informsystema.ru/uploader/fileUpload?name=3992.pdf&show=dcatalogues/1/1532

498/3992.pdf&view=true (дата обращения 11.02.2021 г.) - Макрообъект. - Текст : электронный. - Сведения доступны также на CD-ROM.

4. Немцев, В. Н. Мировые валютные системы и риски глобальной экономики : учебно-методическое пособие [для вузов] / В. Н. Немцев, М. Г. Абилова ; МГТУ. - Магнитогорск : МГТУ, 2019. - 1 электрон. опт. диск (CD-ROM). - Загл. с титул. экрана. - URL: https://magtu.informsystema.ru/uploader/fileUpload?name=3857.pdf&show=dcatalogues/1/1529992/3857.pdf&view=true (дата обращения 11.02.2021 г.) - Макрообъект. - ISBN 978-5-9967-1514-5. - Текст : электронный. - Сведения доступны также на CD-ROM.3. Порядок подготовки и защиты выпускной квалификационной работы

в) Методические указания:

Методические указания представлены в приложении 15

г) Программное обеспечение и Интернет-ресурсы:

Программное обеспечение

Наименование ПО	№ договора	Срок действия лицензии
MS Windows 7 Professional(для классов)	Д-1227-18 от 08.10.2018	11.10.2021
MS Office 2007 Professional	№ 135 от 17.09.2007	бессрочно
7Zip	свободно распространяемое ПО	бессрочно
FAR Manager	свободно распространяемое ПО	бессрочно

Профессиональные базы данных и информационные справочные

Название курса	Ссылка
Электронная база периодических изданий East View Information	https://dlib.eastview.com/
Национальная информационно-аналитическая система – Российский индекс научного цитирования	URL: https://elibrary.ru/project_risc.asp
Поисковая система Академия Google (Google Scholar)	URL: https://scholar.google.ru/
Информационная система - Единое окно доступа к информационным	URL: http://window.edu.ru/
Электронные ресурсы библиотеки МГТУ им. Г.И. Носова	http://magtu.ru:8085/marcweb2/Default.asp
Федеральный образовательный портал – Экономика. Социология.	http://ecsocman.hse.ru/
Международная наукометрическая реферативная и полнотекстовая база данных научных изданий «Web of	http://webofscience.com
Международная реферативная и полнотекстовая справочная база данных научных изданий «Scopus»	http://scopus.com

3. Порядок подготовки и защиты выпускной квалификационной работы

Выполнение и защита выпускной квалификационной работы является одной из форм государственной итоговой аттестации.

При выполнении выпускной квалификационной работы, обучающиеся должны показать свои знания, умения и навыки самостоятельно решать на современном уровне задачи своей профессиональной деятельности, профессионально излагать специальную информацию, научно аргументировать и защищать свою точку зрения.

Обучающий, выполняющий выпускную квалификационную работу должен показать свою способность и умение:

- определять и формулировать проблему исследования с учетом ее актуальности;
- ставить цели исследования и определять задачи, необходимые для их достижения;
- анализировать и обобщать теоретический и эмпирический материал по теме исследования, выявлять противоречия, делать выводы;
- применять теоретические знания при решении практических задач;
- делать заключение по теме исследования, обозначать перспективы дальнейшего изучения исследуемого вопроса;
- оформлять работу в соответствии с установленными требованиями;

3.1 Подготовительный этап выполнения выпускной квалификационной работы

3.1.1 Выбор темы выпускной квалификационной работы

Обучающийся самостоятельно выбирает тему из рекомендуемого перечня тем ВКР, представленного в Приложении 14. Обучающийся (несколько обучающихся, выполняющих ВКР совместно), по письменному заявлению, имеет право предложить свою тему для выпускной квалификационной работы, в случае ее обоснованности и целесообразности ее разработки для практического применения в соответствующей области профессиональной деятельности или на конкретном объекте профессиональной деятельности. Утверждение тем ВКР и назначение руководителя утверждается приказом по университету.

3.1.2 Функции руководителя выпускной квалификационной работы

Для подготовки выпускной квалификационной работы обучающемуся назначается руководитель и, при необходимости, консультанты.

Руководитель ВКР помогает обучающемуся сформулировать объект, предмет исследования, выявить его актуальность, научную новизну, разработать план исследования; в процессе работы проводит систематические консультации.

Подготовка ВКР обучающимся и отчет перед руководителем реализуется согласно календарному графику работы. Календарный график работы обучающегося составляется на весь период выполнения ВКР с указанием очередности выполнения отдельных этапов и сроков отчетности по выполнению работы перед руководителем.

3.2 Требования к выпускной квалификационной работе

При подготовке выпускной квалификационной работы обучающийся руководствуется методическими указаниями: Немцев, В. Н. Систематизация и апробация научных исследований : учебно-методическое пособие [для вузов] / В. Н. Немцев, М. Г. Абилова ; МГТУ. - Магнитогорск : МГТУ, 2019. - 1 электрон. опт. диск (CD-ROM). - Загл.

с титул. экрана. - URL: https://magtu.informsystema.ru/uploader/fileUpload?name=3809.pdf&show=dcatalogues/1/1529977/3809.pdf&view=true (дата обращения: 25.09.2020). - Макрообъект. - ISBN 978-5-9967-1515-2. - Текст : электронный. - Сведения доступны также на CD-ROM и локальными нормативными актами университета СМК-О-СМГТУ-36-20 Выпускная квалификационная работа: структура, содержание, общие правила выполнения и оформления.

3.3 Порядок защиты выпускной квалификационной работы

Законченная выпускная квалификационная работа должна пройти процедуру нормоконтроля, включая проверку на объем заимствований, а затем представлена руководителю для оформления письменного отзыва. После оформления отзыва руководителя ВКР направляется на рецензию. Рецензент оценивает значимость полученных результатов, анализирует имеющиеся в работе недостатки, характеризует качество ее оформления и изложения, дает заключение (рецензию) о соответствии работы предъявляемым требованиям в письменном виде.

Выпускная квалификационная работа, подписанная заведующим кафедрой, имеющая рецензию и отзыв руководителя работы, допускается к защите и передается в государственную экзаменационную комиссию не позднее, чем за 2 календарных дня до даты защиты, также работа размещается в электронно-библиотечной системе университета.

Объявление о защите выпускных работ вывешивается на кафедре за несколько дней до защиты.

Защита выпускной квалификационной работы проводится на заседании государственной экзаменационной комиссии и является публичной. Защита одной выпускной работы не должна превышать 30 минут.

Для сообщения обучающемуся предоставляется не более 10 минут. Сообщение по содержанию ВКР сопровождается необходимыми графическими материалами и/или презентацией с раздаточным материалом для членов ГЭК. В ГЭК могут быть представлены также другие материалы, характеризующие научную и практическую ценность выполненной ВКР – печатные статьи с участием выпускника по теме ВКР, документы, указывающие на практическое применение ВКР, макеты, образцы материалов, изделий и т.п.

В своем выступлении обучающийся должен отразить:

- содержание проблемы и актуальность исследования;
- цель и задачи исследования;
- объект и предмет исследования;
- методику своего исследования;
- полученные теоретические и практические результаты исследования;
- выводы и заключение.

В выступлении должны быть четко обозначены результаты, полученные в ходе исследования, отмечена теоретическая и практическая ценность полученных результатов. По окончании выступления выпускнику задаются вопросы по теме его работы. Вопросы могут задавать все присутствующие. Все вопросы протоколируются.

Затем слово предоставляется научному руководителю, который дает характеристику работы. При отсутствии руководителя отзыв зачитывается одним из членов ГЭК.

После этого выступает рецензент или рецензия зачитывается одним из членов ГЭК.

Заслушав официальную рецензию своей работы, студент должен ответить на вопросы и замечания рецензента.

Затем председатель ГЭК просит присутствующих выступить по существу выпускной квалификационной работы. Выступления членов комиссии и присутствующих на защите (до 2-3 мин. на одного выступающего) в порядке свободной дискуссии и обмена мнениями не являются обязательным элементом процедуры, поэтому, в случае отсутствия желающих выступить, он может быть опущен.

После дискуссии по теме работы студент выступает с заключительным словом. Этика защиты предписывает при этом выразить благодарность руководителю и рецензенту за проделанную работу, а также членам ГЭК и всем присутствующим за внимание.

3.4 Критерии оценки выпускной квалификационной работы

Результаты защиты ВКР определяются оценками: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно» и объявляются **в день защиты**.

Решение об оценке принимается на закрытом заседании ГЭК по окончании процедуры защиты всех работ, намеченных на данное заседание. Для оценки ВКР государственная экзаменационная комиссия руководствуется следующими критериями:

- актуальность темы;
- научно-практическое значение темы;
- качество выполнения работы, включая демонстрационные и презентационные материалы;
- содержательность доклада и ответов на вопросы;
- умение представлять работу на защите, уровень речевой культуры.

Оценка **«отлично»** (5 баллов) выставляется за глубокое раскрытие темы, полное выполнение поставленных задач, логично изложенное содержание, качественное оформление работы, соответствующее требованиям локальных актов, высокую содержательность доклада и демонстрационного материала, за развернутые и полные ответы на вопросы членов ГЭК;

Оценка **«хорошо»** (4 балла) выставляется за полное раскрытие темы, хорошо проработанное содержание без значительных противоречий, в оформлении работы имеются незначительные отклонения от требований, высокую содержательность доклада и демонстрационного материала, за небольшие неточности при ответах на вопросы членов ГЭК.

Оценка **«удовлетворительно»** (3 балла) выставляется за неполное раскрытие темы, выводов и предложений, носящих общий характер, в оформлении работы имеются незначительные отклонения от требований, отсутствие наглядного представления работы и затруднения при ответах на вопросы членов ГЭК.

Оценка **«неудовлетворительно»** (2 балла) выставляется за частичное раскрытие темы, необоснованные выводы, за значительные отклонения от требований в оформлении и представлении работы, когда обучающийся допускает существенные ошибки при ответе на вопросы членов ГЭК.

Оценка **«неудовлетворительно»** (1 балл) выставляется за необоснованные выводы,

за значительные отклонения от требований в оформлении и представлении работы, отсутствие наглядного представления работы, когда обучающийся не может ответить на вопросы членов ГЭК.

Оценки «отлично», «хорошо», «удовлетворительно» означают успешное прохождение государственного аттестационного испытания, что является основанием для выдачи обучающемуся документа о высшем образовании и о квалификации образца, установленного Министерством образования и науки Российской Федерации.

Приложение 1

Данные отчетности для оценки стратегических рисков капитализации промышленной компании по состоянию на конец 2019 и 2020 гг., млн. руб.

Наименование показателей	Значение показателей	
	2015	2016
ВНЕОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ		
1. Нематериальные активы	282	704
2. Основные средства	32108	39430
3. Незавершенное строительство	221	176
4. Доходные вложения в материальные ценности	398	542
5. Долгосрочные финансовые вложения	610	388
6. Прочие внеоборотные активы	49	80
Итого по разделу I	33668	41320
в т.ч. неходовые материальные ценности	31	33
ОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ		
1. Запасы:	21773	23078
- сырье, материалы и др. - затраты в незавершенном производстве - готовая продукция и товары для продажи - товары отгруженные - расходы будущих периодов - прочие запасы	19383 314 2029 15 26 6	20046 368 2618 12 28 6
2. НДС по приобретенным ценностям	3179	3259
3. Дебиторская задолженность (платежи более чем через 12 месяцев после отчетной даты)	1 055	843
в т.ч. покупатели и заказчики	–	–
4. Дебиторская задолженность (платежи в течение 12 месяцев после отчетной даты)	16377	18400
в т.ч. покупатели и заказчики	4410	4687
5. Авансы выданные	883	946
6. Прочие дебиторы	1063	1256
7. Краткосрочные финансовые вложения	4082	3892
8. Денежные средства	166	150
9. Прочие оборотные активы	–	–
Итого по разделу II	48578	51824
Итого активов	82246	93144
КАПИТАЛ И РЕЗЕРВЫ		
1. Уставный капитал	21750	21750
2. Добавочный капитал	983	1050
3. Резервный капитал	5834	5834
4. Нераспределенная прибыль	2866	7025
Итого по разделу III	31433	35659
ДОЛГОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА		
1. Займы и кредиты	14255	16810
2. Прочие долгосрочные обязательства	303	450
Итого по разделу IV	14558	17260
КРАТКОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА		
1. Займы и кредиты	21734	25629
2. Кредиторская задолженность:	12937	12740
- поставщики и подрядчики - задолженность перед персоналом - задолженность перед государственными внебюджетными фондами - задолженность по налогам и сборам	11711 389 109 728	11375 376 102 887
3. Авансы полученные	772	990
4. Прочие кредиторы		
5. Задолженность перед учредителями по выплате доходов	–	–

6. Доходы будущих периодов	812	866
7. Резервы предстоящих расходов	–	–
8. Прочие краткосрочные обязательства	–	–
Итого по разделу V	36255	40225
Итого пассивов	82246	93144
Выручка от реализации продукции	41178	45633
ЧИСТАЯ ПРИБЫЛЬ КОМПАНИИ	6835	9822
ВЕЛИЧИНА РЕИНВЕСТИРУЕМОЙ ЧИСТОЙ ПРИБЫЛИ	3465	3922

Приложение 2

Данные отчетности для оценки тактических рисков капитализации промышленной компании по состоянию на конец 2019 и 2020 гг., млн. руб.

Наименование показателей	Значение показателей	
	2015	2016
ВНЕОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ		
1. Нематериальные активы	171	263
2. Основные средства	38022	40537
3. Незавершенное строительство	103	83
4. Доходные вложения в материальные ценности	102	146
5. Долгосрочные финансовые вложения	404	363
6. Прочие внеоборотные активы	34	72
Итого по разделу I	38836	41464
в т.ч. неходовые материальные ценности	28	25
ОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ		
1. Запасы:	23078	26006
- сырье, материалы и др. - затраты в незавершенном производстве - готовая продукция и товары для продажи - товары отгруженные - расходы будущих периодов - прочие запасы	19023 892 3100 32 27 4	21516 917 3499 34 33 7
2. НДС по приобретенным ценностям	3620	3872
3. Дебиторская задолженность (платежи более чем через 12 месяцев после отчетной даты)	522	501
в т.ч. покупатели и заказчики	–	–
4. Дебиторская задолженность (платежи в течение 12 месяцев после отчетной даты)	12484	14501
в т.ч. покупатели и заказчики	3322	2607
5. Авансы выданные	760	502
6. Прочие дебиторы	1022	1053
7. Краткосрочные финансовые вложения	1855	1925
8. Денежные средства	364	387
9. Прочие оборотные активы	–	–
Итого по разделу II	43705	48747
Итого активов	82541	90211
КАПИТАЛ И РЕЗЕРВЫ		
1. Уставный капитал	25550	25550
2. Добавочный капитал	1222	1309
3. Резервный капитал	6699	6753
4. Нераспределенная прибыль	6975	10336
Итого по разделу III	40446	43948
ДОЛГОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА		
1. Займы и кредиты	10093	11092
2. Прочие долгосрочные обязательства	352	288
Итого по разделу IV	10445	11380
КРАТКОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА		
1. Займы и кредиты	18840	21045
2. Кредиторская задолженность:	11187	12528
- поставщики и подрядчики - задолженность перед персоналом - задолженность перед государственными внебюджетными фондами - задолженность по налогам и сборам	10286 333 93 475	11509 377 105 537
3. Авансы полученные	780	593
4. Прочие кредиторы		
5. Задолженность перед учредителями по выплате доходов	–	–
6. Доходы будущих периодов	843	717

7. Резервы предстоящих расходов	–	–
8. Прочие краткосрочные обязательства	–	–
Итого по разделу V	31650	34883
Итого пассивов	82541	90211
ВЫРУЧКА ОТ РЕАЛИЗАЦИИ ПРОДУКЦИИ	40989	44878
ЧИСТАЯ ПРИБЫЛЬ КОМПАНИИ	9118	8327
ВЕЛИЧИНА РЕИНВЕСТИРУЕМОЙ ЧИСТОЙ ПРИБЫЛИ	3198	3477

Приложение 3

Исходные данные для оценки риска финансирования сбыта компании

Объем производства продукции S_i, млн. руб.		Прогнозная валовая прибыль в зависимости от конъюнктуры рынка ΣW_j, млн. руб.			
		4000	6000	10000	13000
S_1	5000	1620	2252	2252	2252
S_2	8000	– 2498	1767	2967	2967
S_3	11000	– 4025	-1083	3115	3844
S_4	13000	– 7383	-3430	1683	5107

Приложение 4

Исходные данные для оценки риска финансирования сбыта компании

Объем производства продукции S_i, млн. руб.		Прогнозная валовая прибыль в зависимости от конъюнктуры рынка ΣW_j, млн. руб.			
		4000	6000	10000	13000
S_1	4000	1785	1854	1854	1854
S_2	7000	– 1444	2270	2940	2940
S_3	10000	– 3265	-883	3652	3652
S_4	13000	– 7383	-3430	1683	5107

Приложение 5

Исходные данные для оценки риска финансирования сбыта компании

Объем производства продукции S_i, млн. руб.		Прогнозная валовая прибыль в зависимости от конъюнктуры рынка ΣW_j, млн. руб.			
		4000	6000	10000	13000
S_1	3000	1280	1280	1280	1280
S_2	6000	– 1041	2775	2775	2775
S_3	11000	– 4025	-1083	3115	3844
S_4	13000	– 7383	-3430	1683	5107

Приложение 6

Исходные данные для оценки риска финансирования сбыта компании

Объем производства продукции S_i, млн. руб.		Прогнозная валовая прибыль в зависимости от конъюнктуры рынка ΣW_j, млн. руб.			
		4000	6000	10000	13000
S_1	5000	1620	2252	2252	2252
S_2	8000	– 2498	1767	2967	2967
S_3	11000	– 4025	-1083	3115	3844
S_4	13000	– 7383	-3430	1683	5107

Приложение 7

Исходные данные для оценки риска ИТ- проекта

Факторы	Эксперты							$\sum x_i$
	1	2	3	4	5	6	7	
$X1$	1	3	2	4	5	3	3	
$X2$	4	5	5	5	4	5	5	
$X3$	3	2	3	1	2	2	1	
$X4$	2	1	1	2	1	1	2	
$X5$	5	4	4	3	3	4	4	
Сумма	15	15	15	15	15	15	15	

Приложение 8

Исходные данные для оценки риска ИТ- проекта

Факторы	Эксперты							$\sum x_i$
	1	2	3	4	5	6	7	
$X1$	1	1	2	3	3	2	2	
$X2$	2	3	3	2	4	4	1	
$X3$	3	2	1	1	5	3	3	
$X4$	4	5	4	5	2	4	5	
$X5$	5	4	5	4	1	1	4	
Сумма	15	15	15	15	15	15	15	

Приложение 9

Исходные данные для оценки риска ИТ- проекта

Факторы	Эксперты							$\sum x_i$
	1	2	3	4	5	6	7	
$X1$	2	3	4	3	2	1	3	
$X2$	3	5	3	2	3	2	2	
$X3$	1	2	2	4	5	3	5	
$X4$	4	1	1	1	4	5	1	
$X5$	5	4	5	5	1	4	4	
Сумма	15	15	15	15	15	15	15	

Приложение 10

Исходные данные для оценки риска ИТ- проекта

Факторы	Эксперты							$\sum x_i$
	1	2	3	4	5	6	7	
$X1$	3	4	2	1	5	4	3	
$X2$	2	3	3	4	3	3	5	
$X3$	4	2	4	2	2	2	1	
$X4$	1	1	1	3	1	1	2	
$X5$	5	5	5	5	4	5	4	
Сумма	15	15	15	15	15	15	15	

Приложение 11

Исходные данные для оценки риска ИТ- проекта

Факторы	Эксперты							$\sum x_i$
	1	2	3	4	5	6	7	
$X1$	1	2	3	1	2	1	3	
$X2$	3	1	2	4	4	2	1	
$X3$	4	5	4	3	3	3	4	
$X4$	5	4	5	5	5	4	2	
$X5$	2	3	1	2	1	5	5	
Сумма	15	15	15	15	15	15	15	

Приложение 12

Исходные данные для оценки риска инвестиционного проекта

Наименование показателей	Значение показателей	
	2019	2020
ВНЕОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ		
1. Нематериальные активы	282	704
2. Основные средства	32108	39430
3. Незавершенное строительство	221	176
4. Доходные вложения в материальные ценности	398	542
5. Долгосрочные финансовые вложения	610	388
6. Прочие внеоборотные активы	49	80
Итого по разделу I	33668	41320
в т.ч. неходовые материальные ценности	31	33
ОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ		
1. Запасы:	21773	23078
- сырье, материалы и др. - затраты в незавершенном производстве - готовая продукция и товары для продажи - товары отгруженные - расходы будущих периодов - прочие запасы	19383 314 2029 15 26 6	20046 368 2618 12 28 6
2. НДС по приобретенным ценностям	3179	3259
3. Дебиторская задолженность (платежи более чем через 12 месяцев после отчетной даты)	1 055	843
в т.ч. покупатели и заказчики	–	–
4. Дебиторская задолженность (платежи в течение 12 месяцев после отчетной даты)	16377	18400
в т.ч. покупатели и заказчики	4410	4687
5. Авансы выданные	883	946
6. Прочие дебиторы	1063	1256
7. Краткосрочные финансовые вложения	4082	3892
8. Денежные средства	166	150
9. Прочие оборотные активы	–	–
Итого по разделу II	48578	51824
Итого активов	82246	93144
КАПИТАЛ И РЕЗЕРВЫ		
1. Уставный капитал	21750	21750
2. Добавочный капитал	983	1050
3. Резервный капитал	5834	5834
4. Нераспределенная прибыль	2866	7025
Итого по разделу III	31433	35659
ДОЛГОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА		
1. Займы и кредиты	14255	16810
2. Прочие долгосрочные обязательства	303	450
Итого по разделу IV	14558	17260
КРАТКОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА		
1. Займы и кредиты	21734	25629
2. Кредиторская задолженность:	12937	12740
- поставщики и подрядчики - задолженность перед персоналом - задолженность перед государственными внебюджетными фондами - задолженность по налогам и сборам	11711 389 109 728	11375 376 102 887
3. Авансы полученные	772	990
4. Прочие кредиторы	-	-
5. Задолженность перед учредителями по выплате доходов	–	–
6. Доходы будущих периодов	812	866
7. Резервы предстоящих расходов	–	–

8. Прочие краткосрочные обязательства	–	–
Итого по разделу V	36255	40225
Итого пассивов	82246	93144

Приложение 13

Исходные данные для оценки риска инвестиционного проекта

Наименование показателей	Значение показателей	
	2019	2020
ВНЕОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ		
1. Нематериальные активы	171	263
2. Основные средства	38022	40537
3. Незавершенное строительство	103	83
4. Доходные вложения в материальные ценности	102	146
5. Долгосрочные финансовые вложения	404	363
6. Прочие внеоборотные активы	34	72
Итого по разделу I	38836	41464
в т.ч. неходовые материальные ценности	28	25
ОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ		
1. Запасы:	23078	26006
- сырье, материалы и др. - затраты в незавершенном производстве - готовая продукция и товары для продажи - товары отгруженные - расходы будущих периодов - прочие запасы	19023 892 3100 32 27 4	21516 917 3499 34 33 7
2. НДС по приобретенным ценностям	3620	3872
3. Дебиторская задолженность (платежи более чем через 12 месяцев после отчетной даты)	522	501
в т.ч. покупатели и заказчики	–	–
4. Дебиторская задолженность (платежи в течение 12 месяцев после отчетной даты)	12484	14501
в т.ч. покупатели и заказчики	3322	2607
5. Авансы выданные	760	502
6. Прочие дебиторы	1022	1053
7. Краткосрочные финансовые вложения	1855	1925
8. Денежные средства	364	387
9. Прочие оборотные активы	–	–
Итого по разделу II	43705	48747
Итого активов	82541	90211
КАПИТАЛ И РЕЗЕРВЫ		
1. Уставный капитал	25550	25550
2. Добавочный капитал	1222	1309
3. Резервный капитал	6699	6753
4. Нераспределенная прибыль	6975	10336
Итого по разделу III	40446	43948
ДОЛГОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА		
1. Займы и кредиты	10093	11092
2. Прочие долгосрочные обязательства	352	288
Итого по разделу IV	10445	11380
КРАТКОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА		
1. Займы и кредиты	18840	21045
2. Кредиторская задолженность:	11187	12528
- поставщики и подрядчики - задолженность перед персоналом - задолженность перед государственными внебюджетными фондами - задолженность по налогам и сборам	10286 333 93 475	11509 377 105 537
3. Авансы полученные	780	593
4. Прочие кредиторы		
5. Задолженность перед учредителями по выплате доходов	–	–
6. Доходы будущих периодов	843	717
7. Резервы предстоящих расходов	–	–
8. Прочие краткосрочные обязательства	–	–

Итого по разделу V	31650	34883
Итого пассивов	82541	90211

Приложение 14

Примерный перечень тем выпускных квалификационных работ

1. Совершенствование инструментов внутрифирменного планирования в риск-менеджменте промышленного предприятия.
2. Совершенствование инструментов стратегического планирования в риск-менеджменте промышленного предприятия.
3. Совершенствование инструментов внутрифирменного планирования в риск-менеджменте коммерческого банка.
4. Совершенствование инструментов стратегического планирования в риск-менеджменте коммерческого банка.
5. Совершенствование инструментов внутрифирменного планирования в риск-менеджменте страховой компании.
6. Совершенствование инструментов стратегического планирования в риск-менеджменте страховой компании.
7. Совершенствование инструментов стратегического планирования в риск-менеджменте инвестиционной компании.
8. Оптимизация рисков структурных преобразований в промышленности.
9. Оптимизация рисков структурных преобразований в банковской сфере.
10. Оптимизация рисков структурных преобразований в страховой отрасли.
11. Совершенствование системы оценки и страхования рисков промышленного предприятия.
12. Совершенствование системы оценки и страхования рисков коммерческого банка.
13. Совершенствование системы оценки и страхования рисков страховой компании.
14. Совершенствование системы оценки и страхования рисков инвестиционной компании.
15. Разработка методов и инструментов повышения энергетической безопасности и экономически устойчивого развития предприятий топливно-энергетического комплекса России.
16. Исследование рисковых аспектов инновационной политики в условиях предприятий топливно-энергетического комплекса.
17. Исследование рисковых аспектов инновационной политики в условиях предприятий машиностроительного комплекса.
18. Исследование рисковых аспектов инновационной политики в условиях предприятий металлургического комплекса.
19. Оптимизация рисков промышленной компании на основе формирования систем контроллинга.
20. Совершенствование методики оценки инновационных рисков промышленного предприятия.
21. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) оптимизации рисков венчурных организаций.
22. Разработка методов (инструментов) оценки инновационного потенциала организации в системе риск-менеджмента.
23. Совершенствование методов оценки инновационной активности организаций как элемент обеспечения их устойчивости.
24. Совершенствование механизма оценки инновационной активности организаций как инструмента их капитализации.
25. Совершенствование формирования инновационной стратегии организации на основе оптимизации риска.
26. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) риск-менеджмента организаций на основе сбалансированной системы показателей.
27. Совершенствование риск-менеджмента инвестирования простого (расширенного) основного капитала в инновационно активных экономических системах.

28. Разработка методики оценки риска проектного управления в инновационно активных экономических системах.
29. Рисковые аспекты развития нового технологического уклада экономических систем.
30. Исследование рисковых аспектов интеллектуального капитала современных организаций.
31. Совершенствование методики управления рисками современной организации в промышленности (банковской, страховой сфере).
32. Совершенствование инструментария управления рисками современной организации в промышленности (банковской, страховой сфере).
33. Совершенствование механизма управления рисками современной организации в промышленности (банковской, страховой сфере).
34. Оценка риска и совершенствование управления человеческим капиталом организации в целях инновационного развития.
35. Развитие методики и инструментария управления рисками предпринимательской деятельности.
36. Разработка системы управления инфраструктурными рисками предпринимательской деятельности.
37. Совершенствование систем риск-менеджмента в предпринимательской деятельности.
38. Формирование многокритериальных оценок эффективности предпринимательской деятельности в условиях высокого инновационного риска.
39. Формирование многокритериальных оценок устойчивости предпринимательской деятельности в условиях высокого инновационного риска.
40. Формирование многокритериальных оценок уровня деловой активности предпринимательской деятельности в условиях высокого инновационного риска.
41. Формирование многокритериальных оценок уровня инвестиционной активности предприятия в условиях высокого инновационного риска.
42. Совершенствование методики (инструментария, механизма) управления рисками it-проектов.
43. Совершенствование методики (инструментария, механизма) управления рисками электронного бизнеса.
44. Совершенствование методов применения информационных технологий в системе риск-менеджмента.
45. Развитие методов управления риском в условиях корпоративной инновационной системы.
46. Совершенствование методов (инструментария) управления риском в современных производственных системах.
47. Исследование создания и удержания рисков ключевых компетенций для обеспечения конкурентоспособности бизнеса.
48. Развитие систем управления риском слияний и поглощений в российской экономике (по отраслям, регионам, комплексам).
49. Совершенствование методов управления риском трудовых ресурсов в современных организациях (на примере отрасли, комплекса, сферы или сектора экономики).
50. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) риск-менеджмента в системе антикризисного управления.
51. Совершенствование методики (механизмов, инструментов) управления финансовыми рисками организаций в современных условиях.
52. Развитие методики (инструментария) финансового планирования в условиях высокого инновационного риска.
53. Развитие методики (инструментария) управления финансовыми рисками в условиях бюджетного процесса.
54. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) финансового мониторинга на основе применения информационных технологий.
55. Развитие методики (инструментария) управления налоговыми рисками (в различных экономических системах).
56. Развитие методики (инструментария) управления кредитными рисками (в различных

экономических системах).
57. Развитие системы финансовых ресурсов организаций в условиях высокого инновационного риска.
58. Оптимизация структуры финансовых ресурсов организаций в условиях высокого инновационного риска.
59. Исследование рисков финансового взаимодействия государства и корпораций в кризисных условиях.
60. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) управления портфельными рисками (в организациях различных сфер деятельности).
61. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) управления портфельными рисками (в организациях различных сфер деятельности).
62. Оптимизация риска налогового портфеля (в организациях различных сфер деятельности).
63. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) оценки рисков проектного финансирования.
64. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) управления рисками проектного финансирования.
65. Повышение роли риск-менеджмента в системе управления финансовой деятельностью современной корпорации.
66. Развитие методов оценки риска и их влияния на рыночную стоимость предприятия.
67. Совершенствование методов (инструментов) оценки рисков финансовых активов предприятия.
68. Совершенствование методов (инструментов) оценки рисков интеллектуального капитала предприятия.
69. Совершенствование методов (инструментов) оценки рисков информационных систем и ресурсов предприятия.
70. Совершенствование методов (инструментов, механизма) управления риском портфеля ценных бумаг предприятия.
71. Совершенствование методов (инструментов, механизма) управления валютным риском предприятия.
72. Совершенствование методики (инструментария, механизмов) прогнозирования и мониторинга развития страхования и рынка страховых услуг.
73. Совершенствование финансового и налогового регулирования развития и эффективного функционирования обязательного и добровольного страхования.
74. Формирование новых видов страховых продуктов как необходимый компонент повышения конкурентоспособности страхового бизнеса.
75. Разработка методов (инструментов, механизмов) повышения конкурентоспособности страховых услуг.
76. Разработка методов (инструментов, механизмов) повышения конкурентоспособности страховых компаний.
77. Совершенствование методов (инструментов) повышения эффективности инвестиционного портфеля страховой компании.
78. Совершенствование методов составления рейтингов и раскрытия информации страховых компаний.
79. Совершенствование методов составления рейтингов и раскрытия информации паевых инвестиционных фондов.
80. Совершенствование методов составления рейтингов и раскрытия информации пенсионных фондов.
81. Исследование рисков развития современного банковского сектора российской экономики.
82. Совершенствование механизмов (инструментов) управления рисками межбанковской конкуренции.
83. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) оценки и обеспечения надежности коммерческого банка.
84. Совершенствование методов оценки портфеля активов российских банков и его

оптимизации.
85. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) управления рисками формирования и использования банковских резервов.
86. Исследование рисковых аспектов создания и внедрения новых банковских продуктов.
87. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) управления рисками небанковских кредитных организаций.
88. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) управления рисками банковской деятельности на финансовом и денежном рынках.
89. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) оценки инвестиционных рисков в системе антикризисного управления.
90. Совершенствование управления развитием производства в условиях неопределенности и риска.
91. Совершенствование методов (инструментария) управления инновационным проектом как объектом риск-менеджмента.
92. Совершенствование методов (инструментов) оценки рисков интеллектуального капитала в условиях реализации инновационной стратегии предприятия.
93. Совершенствование методики адаптивного динамического управления инвестиционными рисками.
94. Совершенствование функционального конгтроллинга в риск-менеджменте.
95. Совершенствование управления факторами чувствительности к инвестиционным рискам.
96. Совершенствование методов устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса).
97. Разработка новых методов устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса).
98. Адаптация существующих механизмов устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса).
99. Адаптация существующих инструментов устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса).
100. Разработка новых механизмов устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса).
101. Разработка новых инструментов устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса).
102. Исследование и оценка механизмов формирования корпоративных образований в российской экономике с учетом процессов глобализации.
103. Исследование и оценка механизмов формирования корпоративных образований в российской экономике с учетом кризисных явлений.
104. Исследование и оценка механизмов формирования корпоративных образований в российской экономике с закономерностей циклического развития.

Приложение 15

Методические указания

Термины и определения

выпускная квалификационная работа - представляет собой выполненную обучающимся (несколькими обучающимися совместно) работу, демонстрирующую уровень подготовленности выпускника к самостоятельной профессиональной деятельности;

государственная итоговая аттестация - итоговая аттестация, завершающая освоение обучающимися образовательных программ, имеющих государственную аккредитацию;

государственный экзамен - форма итоговой аттестации обучающегося по учебной дисциплине (группе дисциплин) и (или) модулям образовательной программы, результаты освоения которых имеют определяющее значение для профессиональной деятельности выпускников, с установлением уровня освоения знаний, умений и компетенций;

защита выпускной квалификационной работы - форма итоговой аттестации обучающегося с установлением уровня освоения знаний, умений, навыков и компетенций в соответствии с требованиями образовательной программы по направлению подготовки (специальности), демонстрирующая уровень подготовленности выпускника к самостоятельной профессиональной деятельности;

Целью ГИА является определение соответствия результатов освоения обучающимися образовательных программ соответствующим требованиям федерального государственного образовательного стандарта, а также установление уровня подготовки выпускника к выполнению профессиональных задач.

Государственная итоговая аттестация проводится в сроки, определяемые календарным учебным графиком по каждому направлению подготовки.

В расписании указываются даты, время и место проведения предэкзаменационных консультаций, государственных аттестационных испытаний.

К ГИА допускается обучающийся, не имеющий академической задолженности и в полном объеме выполнивший учебный план или индивидуальный учебный план по соответствующей образовательной программе высшего образования.

Краткие методические рекомендации к подготовке к государственному экзамену

Сдача государственного экзамена подводит итог аудиторной и самостоятельной работы обучающихся по изучению профессионально важных учебных дисциплин.

Лучшим методом подготовки к государственному экзамену является планомерная, систематическая, настойчивая работа в течение всего периода обучения, так как за несколько дней, предшествующих государственному экзамену, можно лишь повторить материал, обобщить и систематизировать свои знания. Заново изучить материал за это время невозможно.

В помощь студентам перед государственным экзаменом ведущими преподавателями выпускающей кафедры проводятся обзорные лекции. На них преподаватели знакомят студентов с порядком проведения экзамена, обращают внимание на проблемные вопросы, изменения в законодательстве, отвечают на вопросы, которые вызывают затруднения у студентов, и проводят анализ

ошибок, допущенных студентами в прошлые годы. Без тщательного самостоятельного продумывания материала беседа с консультантом неизбежно будет носить «общий», поверхностный характер и не принесет нужного результата.

В задачу преподавателей не входит проведение обзора по всем вопросам, вынесенным на государственный экзамен, поэтому студент еще до начала обзорных лекций должен повторить основное содержание материала с тем, чтобы лучше запомнить изложенное лектором и задать оставшиеся непонятными вопросы.

На государственном экзамене старайтесь владеть собой и учитесь точно и кратко отвечать на вопросы, поясняя свои ответы примерами, сравнениями.