

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:

ФИО: Ашмарина Светлана Игоревна

Должность: Ректор ФГБОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 29.01.2021 12:37:57

Уникальный программный ключ:

59650034d6e3a6baac49b7bd0f8e79fea1433ff3e82f1fc7e9279a031181baba

**Министерство науки и высшего образования Российской Федерации**  
**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение**  
**высшего образования**  
**«Самарский государственный экономический университет»**

**Институт** экономики предприятий

**Кафедра** Учета, анализа и экономической безопасности

**УТВЕРЖДЕНО**

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 29 апреля 2020 г.)

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

**Наименование дисциплины** Б1.Б.31 Анализ и управление рисками

**Основная профессиональная образовательная программа** 38.05.01 ЭКОНОМИЧЕСКАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ программа специализация N 1 "Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности"

Методический отдел УМУ

« 16 » \_\_\_\_\_ 2020 г.

\_\_\_\_\_ / *Красина*

Научная библиотека СГЭУ

« 16 » \_\_\_\_\_ 2020 г.

\_\_\_\_\_ / *Тимова*

Рассмотрено к утверждению

на заседании кафедры Учета, анализа и

экономической безопасности

(протокол № 8 от 24.03.2020г.)

Зав. кафедрой \_\_\_\_\_ / Пискунов В.А. /

Квалификация (степень) выпускника экономист

## Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

## 1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Анализ и управление рисками входит в базовую часть блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Экономика организации (предприятия), Эконометрика, Менеджмент

Последующие дисциплины по связям компетенций: Экономическая безопасность в инвестиционной и инновационной сферах, Мониторинг финансово-хозяйственной деятельности, Стратегический анализ

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Анализ и управление рисками в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

### Общекультурные компетенции (ОК):

ОК-8 - способностью принимать оптимальные организационно-управленческие решения

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ОК-8	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ОК8з1: методологические основы и функции управления, принципы разработки организационно-управленческих решений, виды ответственности за принятые организационно-управленческие решения	ОК8у1: творчески решать профессиональные задачи, проявлять инициативу, в том числе в ситуациях риска, принимать ответственность за свои решения в рамках профессиональной компетенции	ОК8в1: навыками постановки стратегических целей и решения практических задач, связанных с принятием оптимальных организационно-управленческих решений
	ОК8з2: технологию, способы и методы реализации оптимальных организационно-управленческих решений	ОК8у2: аргументировать принятие оптимальных организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности	ОК8в2: методами и приемами принятия организационно-управленческих решений

### Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-34 - способностью проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-34	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК34з1: требования к уровням и динамике показателей	ПК34у1: обосновывать состав показателей экономических разделов	ПК34в1: навыками разработки экономических разделов планов в

	экономических разделов плана, обеспечивающие экономическую безопасность хозяйствующих субъектов	плана, рассчитывать и интерпретировать результаты расчетов в соответствии с требованиями эффективного развития хозяйствующих субъектов	соответствии с требованиями экономической безопасности
	ПК34з2: характеристики угроз, возникающих при планировании и осуществлении инновационных проектов	ПК34у2: проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов	ПК34в2: навыками прогнозирования рисков и угроз, возникающих при планировании и осуществлении инновационных проектов

ПК-36 - способностью составлять прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
ПК-36	ПК36з1: прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов	ПК36у1: прогнозировать динамику основных экономических показателей	ПК36в1: навыками прогнозирования экономических процессов и показателей деятельности хозяйствующих субъектов
	ПК36з2: методику проведения экономического анализа деятельности хозяйствующих субъектов, содержание и последовательность проведения комплексного экономического анализа	ПК36у2: анализировать динамику макро- и микроэкономические показатели, использовать полученные данные для решения профессиональных задач	ПК36в2: навыками и правилами расчета основных экономических параметров деятельности хозяйствующих субъектов, методами оценки эффективности работы хозяйствующих субъектов

### 3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

#### Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 6
Контактная работа, в том числе:	65.15/1.81
Занятия лекционного типа	32/0.89
Занятия семинарского типа	32/0.89
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Групповая контактная работа (ГКР)	1/0.03
Самостоятельная работа, в том числе:	59.85/1.66
Промежуточная аттестация	19/0.53
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач

Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	144
Зачетные единицы	4

#### 4. Содержание дисциплины

##### 4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Анализ и управление рисками представлен в таблице.

#### Разделы, темы дисциплины и виды занятий Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе	
		Лекции	Занятия семинарского типа		ИКР			ГКР
			Практич. занятия					
1.	Теория управления рисками	16	16			30	ОК8з1, ОК8з2, ОК8у1, ОК8у2, ОК8в1, ОК8в2, ПК34з1, ПК34з2, ПК34у1, ПК34у2, ПК34в1, ПК34в2, ПК36з1, ПК36з2, ПК36у1, ПК36у2, ПК36в1, ПК36в2	
2.	Анализ рисков	16	16			29,85	ОК8з1, ОК8з2, ОК8у1, ОК8у2, ОК8в1, ОК8в2, ПК34з1, ПК34з2, ПК34у1, ПК34у2, ПК34в1, ПК34в2, ПК36з1, ПК36з2, ПК36у1, ПК36у2, ПК36в1, ПК36в2	
	Контроль			19				
	<b>Итого</b>	<b>32</b>	<b>32</b>	<b>0.15</b>	<b>1</b>	<b>59.85</b>		

##### 4.2 Содержание разделов и тем

###### 4.2.1 Контактная работа

###### Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Теория управления рисками	лекция	Понятие риска
		лекция	Взаимосвязь риска и неопределенности
		лекция	Классификация рисков
		лекция	Нормативные акты в управлении рисками
		лекция	Подходы в управлении рисками
		лекция	Риск-менеджмент и система внутреннего контроля
		лекция	

		лекция	
2.	Анализ рисков	лекция	Методы оценки рисков: количественные и качественные
		лекция	Вероятность и влияние как две основные единицы измерения риска
		лекция	Экспертная оценка рисков
		лекция	Матрица рисков
		лекция	Контрольные процедуры
		лекция	Методы работы с риском
		лекция	Мониторинг системы управления рисками
		лекция	

\*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

#### Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Теория управления рисками	практическое занятие	Понятие риска
		практическое занятие	Взаимосвязь риска и неопределенности
		практическое занятие	Классификация рисков
		практическое занятие	Нормативные акты в управлении рисками
		практическое занятие	Подходы в управлении рисками
		практическое занятие	Риск-менеджмент и система внутреннего контроля
		практическое занятие	
		практическое занятие	
2.	Анализ рисков	практическое занятие	Методы оценки рисков: количественные и качественные
		практическое занятие	Вероятность и влияние как две основные единицы измерения риска
		практическое занятие	Экспертная оценка рисков
		практическое занятие	Матрица рисков
		практическое занятие	Контрольные процедуры
		практическое занятие	Методы работы с риском
		практическое занятие	Мониторинг системы управления рисками
		практическое занятие	

\*\* семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

#### Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

#### 4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Теория управления рисками	- подготовка доклада

		- тестирование
2.	Анализ рисков	- подготовка доклада - тестирование

\*\*\* самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

## 5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

### 5.1 Литература:

#### Основная литература

Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 414 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00945-3. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.biblio-online.ru/bcode/433253>

#### Дополнительная литература

Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для академического бакалавриата / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 381 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://www.biblio-online.ru/bcode/432142>

#### Литература для самостоятельного изучения

1. Гражданский кодекс Российской Федерации: Части первая, вторая и третья – М.: КонсультантПлюс, 2019. – Режим доступа: <http://www.consultant.ru>.
2. Налоговый кодекс Российской Федерации. – М.: КонсультантПлюс, 2019. – режим доступа: <http://www.consultant.ru>
3. Уголовный кодекс Российской Федерации. – М.: КонсультантПлюс, 2019. – режим доступа: <http://www.consultant.ru>
4. О бухгалтерском учете: федер. закон от 06.12.11. № 402-ФЗ – М.: КонсультантПлюс, 2019. – режим доступа: <http://www.consultant.ru>.
5. 26 положений по бухгалтерскому учету; положение о гл. бухгалтерах. Федер. Закон «О бухгалтерском учете» .-М.: Проспект, 2015. – 233 с. ISBN 978-5-392-05001-7.
6. А.В. Порфирьева, Внутренний контроль: методология сквозного контроля автономных учреждений: монография / А. В. Порфирьева, Т. Ю. Серебрякова. - М. : ИНФРА-М, 2013. - 152 с.

### 5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Office 365 ProPlus, Microsoft Office 2019, Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)

### 5.3. Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

### 5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. Справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

### 5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования
Центр (класс) деловых игр	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Картотека Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ

Для проведения занятий лекционного типа используются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в виде презентационных материалов, обеспечивающих тематические иллюстрации.

## 6. Фонд оценочных средств по дисциплине Анализ и управление рисками:

### 6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком
--------------	----------------	------------------------------



		« + »
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный/письменный опрос	-
	Тестирование	+
	Практические задачи	-
	Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения)	-
Промежуточный контроль	Зачет	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования, утвержденными Ученым советом ФГБОУ ВО СГЭУ №10 от 29.04.2020г.

**6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе**  
**Общекультурные компетенции (ОК):**

ОК-8 - способностью принимать оптимальные организационно-управленческие решения

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ОК8з1: методологические основы и функции управления, принципы разработки организационно-управленческих решений, виды ответственности за принятые организационно-управленческие решения	ОК8у1: творчески решать профессиональные задачи, проявлять инициативу, в том числе в ситуациях риска, принимать ответственность за свои решения в рамках профессиональной компетенции	ОК8в1: навыками постановки стратегических целей и решения практических задач, связанных с принятием оптимальных организационно-управленческих решений
Повышенный	ОК8з2: технологию, способы и методы реализации оптимальных организационно-управленческих решений	ОК8у2: аргументировать принятие оптимальных организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности	ОК8в2: методами и приемами принятия организационно-управленческих решений

**Профессиональные компетенции (ПК):**

ПК-34 - способностью проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК34з1: требования к уровням и динамике показателей экономических разделов	ПК34у1: обосновывать состав показателей экономических разделов плана, рассчитывать и	ПК34в1: навыками разработки экономических разделов планов в соответствии с

	плана, обеспечивающие экономическую безопасность хозяйствующих субъектов	интерпретировать результаты расчетов в соответствии с требованиями эффективного развития хозяйствующих субъектов	требованиями экономической безопасности
Повышенный	ПК34з2: характеристики угроз, возникающих при планировании и осуществлении инновационных проектов	ПК34у2: проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов	ПК34в2: навыками прогнозирования рисков и угроз, возникающих при планировании и осуществлении инновационных проектов

ПК-36 - способностью составлять прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК36з1: прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов	ПК36у1: прогнозировать динамику основных экономических показателей	ПК36в1: навыками прогнозирования экономических процессов и показателей деятельности хозяйствующих субъектов
Повышенный	ПК36з2: методику проведения экономического анализа деятельности хозяйствующих субъектов, содержание и последовательность проведения комплексного экономического анализа	ПК36у2: анализировать динамику макро- и микроэкономические показатели, использовать полученные данные для решения профессиональных задач	ПК36в2: навыками и правилами расчета основных экономических параметров деятельности хозяйствующих субъектов, методами оценки эффективности работы хозяйствующих субъектов

### 6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Теория управления рисками	ОК8з1, ОК8з2, ОК8у1, ОК8у2, ОК8в1, ОК8в2, ПК34з1, ПК34з2, ПК34у1, ПК34у2, ПК34в1, ПК34в2, ПК36з1, ПК36з2, ПК36у1, ПК36у2, ПК36в1, ПК36в2	Оценка докладов Тестирование	зачет

2.	Анализ рисков	ОК8з1, ОК8з2, ОК8у1, ОК8у2, ОК8в1, ОК8в2, ПК34з1, ПК34з2, ПК34у1, ПК34у2, ПК34в1, ПК34в2, ПК36з1, ПК36з2, ПК36у1, ПК36у2, ПК36в1, ПК36в2	Оценка докладов Тестирование	зачет
----	---------------	--	---------------------------------	-------

#### 6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

##### Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Теория управления рисками	<ol style="list-style-type: none"> <li>1.Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия</li> <li>2.Классификация рисков: виды, принципы разработки, использование</li> <li>3.Программа управления рисками: разработка и использование</li> <li>4.Комплексное использование методов управления рисками</li> <li>5.Управление рисками в малом предпринимательстве</li> <li>6.Организация управления рисками на промышленном предприятии</li> <li>7.Организация управления рисками в финансово-кредитном учреждении</li> <li>8.Особенности управления рисками финансово-промышленной группы</li> <li>9.Особенности управления рисками транснациональной корпорации</li> <li>10.Управление рисками инвестиционного проекта</li> <li>11.Управление рисками в антикризисном менеджменте</li> <li>12.Информационное обеспечение управления рисками: принципы создания и использования информационной системы организации.</li> <li>13.Методы оценки эффективности управления рисками</li> <li>14.Использование количественных методов анализа и оценки рисков</li> <li>15.Использование качественных методов анализа и оценки рисков</li> <li>16.Использование превентивных мероприятий по управлению рисками</li> <li>17.Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы</li> <li>18.Инновационные технологии в управлении рисками</li> <li>19.Роль субъективных факторов в управлении рисками</li> <li>20.Правовое обеспечение деятельности по управлению рисками в РФ</li> </ol>
Анализ рисков	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Страхование как экономический механизм снижения и перераспределения риска</li> <li>2. Оценка риска потери платежеспособности.</li> <li>3. Оценка риска потери финансовой устойчивости.</li> <li>4. Непосредственная оценка риска на основе относительных показателей.</li> <li>5. Опосредованная оценка риска на основе относительных показателей.</li> <li>6. Точечная оценка показателя риска.</li> <li>7. Интервальная оценка показателя риска.</li> <li>8. Среднее значение ожидаемого результата деятельности.</li> <li>9. Показатели вариации уровня риска.</li> <li>10. Этап формирования цели и задач экспертного оценивания.</li> <li>11. Выбор метода сбора и отработки экспертной информации.</li> <li>12. Оценка согласованности мнений.</li> <li>13. Факторы финансовой несостоятельности.</li> <li>14. Динамика процесса превращения нормально функционирующего предприятия в банкротства (финансовой несостоятельности).</li> <li>15. Двухфакторная модель прогнозирования банкротства.</li> <li>16. Четырехфакторная модель прогнозирования банкротства.</li> </ol>

	17. Шестифакторная модель прогнозирования риска потери платежеспособности. 18. Пятифакторная модель У.Бивера. 19. Модели диагностики банкротства предприятия. 20. Модели прогнозирования восстановления платежеспособности предприятия. 21. Механизмы нейтрализации риска. 22. Уклонение от рисков. 23. Перенос риска партнерам. 24. Приемы снижения степени риска. Распределение риска. 25. Диверсификация концентрации риска. 26. Лимитирование концентрации риска. 27. Самострахование риска. Хеджирование риска. Страхование риска. 28. Методы компенсации риска. 29. Методы трансформации рисков и их особенности. 30. Метод отказа от риска. 31. Метод снижения частоты ущерба или предотвращения убытка. 32. Метод уменьшения размера убытков. 33. Метод разделения риска. 34. Метод аутсорсинга риска. 35. Методы финансирования рисков. 36. Вопросы для устного опроса(2 балла): 37. Метод покрытия убытка из текущего дохода. Метод покрытия убытков из резервов. 38. Метод покрытия убытка на основе страхования и самострахования. Метод покрытия убытка на основе нестрахового пула. 39. Метод покрытия убытка на основе поддержки государственных органов. 40. Политика управления рисками.
--	--

### Вопросы для устного/письменного опроса

Раздел дисциплины	Вопросы

### Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

<https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

Риск – это...

- разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

Отметьте потери, которые можно отнести к трудовым

- потери рабочего времени
- уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
- уплата дополнительных налогов
- невыполнение сроков сдачи объекта
- потери материалов
- ущерб здоровью
- потери сырья
- ущерб репутации

-выплата штрафа

-потери ценных бумаг

Отметьте потери, которые можно отнести к финансовым

-потери ценных бумаг

-потери сырья

-невыполнение сроков сдачи объекта

-выплата штрафа

-уплата дополнительных налогов

-ущерб репутации

-ущерб здоровью

-потери материалов

-потери рабочего времени

-уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

Отметьте потери, которые можно отнести к потерям времени

-невыполнение сроков сдачи объекта

-потери ценных бумаг

-выплата штрафа

-уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

-уплата дополнительных налогов

-ущерб здоровью

-потери материалов

-потери рабочего времени

-ущерб репутации

-потери сырья

Отметьте потери, которые можно отнести к специальным потерям

-выплата штрафа

-ущерб здоровью

-уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

-потери ценных бумаг

-потери сырья

-уплата дополнительных налогов

-ущерб репутации

-невыполнение сроков сдачи объекта

-потери рабочего времени

-потери материалов

Анализ риска – это...

-систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев,

-позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

-систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные

-объекты, виды деятельности и проекты

-начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом

-выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их

характеристик

Идентификация риска – это...

-систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев,

-позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

-начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом

-выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их

характеристик

-систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные

объекты, виды деятельности и проекты

Риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль, называются

-чистыми

-критическими

-спекулятивными

Последствия риска могут быть

-скорее положительными

-как положительными, так и отрицательными

-только отрицательными

Риски, которые практически всегда несут в себе потери, называются

-критическими

-спекулятивными

-чистыми

Риски, обусловленные деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией, называются

-внешними

-внутренними

-чистыми

Риски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря прибыли, называются

-катастрофическими

-критическими

-допустимыми

Риски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря выручки (т.е. потери превышают ожидаемую прибыль), называются

-катастрофическими

-критическими

-допустимыми

Чем измеряется величина или степень риска?

-средним ожидаемым значение

-изменчивостью возможного результата

-оба варианта верны

Социально-экономическая функция риска состоит

-в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике - отрасли деятельности, в которых риск приемлем

-в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода

-оба варианта верны

Компенсирующая функция риска состоит

-в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике - отрасли деятельности, в которых риск приемлем

-в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода

-оба варианта верны

Защитная функция риска состоит

- в объективной необходимости законодательного закрепления понятия "правомерности риска", правового регулирования страховой деятельности

-в том, что юридические и физические лица вынуждены искать средства и формы защиты от нежелательной реализации риска

-оба варианта верны

Стимулирующая функция риска проявляется

-в том, что реализация решений с неисследованным или необоснованным риском может приводить к реализации объектов или операций, которые относятся к авантюрным

-в исследовании источников риска при проектировании операций и систем, конструировании специальных устройств, операций, форм сделок, исключающих или снижающих возможные последствия риска как отрицательного отклонения

-оба варианта верны

Ущерб имуществу изначально выражается в...

-натуральном виде

-оба варианта верны

-денежной форме

Денежная форма ущерба называется

-убытком

- упущенной выгодой
  - финансовыми потерями
- Отметьте потери, которые можно отнести к материальным
- уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
  - невыполнение сроков сдачи объекта
  - потери рабочего времени
  - потери материалов
  - уплата дополнительных налогов
  - выплата штрафа
  - потери сырья
  - потери ценных бумаг
  - ущерб репутации
  - ущерб здоровью

Систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия называется

- идентификацией рисков
- анализом рисков
- классификацией рисков

**Практические задачи (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с электронным изданием, если имеется)**

Раздел дисциплины	Задачи

**Тематика контрольных работ**

Раздел дисциплины	Темы

### 6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

**Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета**

Раздел дисциплины	Вопросы
Теория управления рисками	<ol style="list-style-type: none"> <li>1.Хозяйственный риск: понятие и классификация.</li> <li>2. Неопределенность: понятие и виды.</li> <li>3. Неопределенность и хозяйственный риск.</li> <li>4. Общая характеристика хозяйственных рисков.</li> <li>5. Функции хозяйственного риска.</li> <li>6. Объекты, субъекты и характерные черты хозяйственного риска.</li> <li>7. Риск как источник прибыли.</li> <li>8. Риск и доходность.</li> <li>9. Факторы риска.</li> <li>10. Система рисков в хозяйственной деятельности.</li> <li>11.Классификация хозяйственных рисков.</li> <li>12.Производственные риски, их классификация и характеристика.</li> <li>13.Финансовые риски, их классификация и характеристика.</li> <li>14.Коммерческие риски, их классификация и характеристика.</li> <li>15.Инвестиционные риски, их классификация и характеристика.</li> <li>16.Валютные риски, их классификация и характеристика.</li> <li>17.Кредитные риски, их классификация и характеристика.</li> <li>18.Банковские риски, их классификация и характеристика.</li> <li>19.Классификация транспортных рисков.</li> <li>20.Факторы внешней среды в управлении хозяйственным риском.</li> </ol>

	<p>21. Факторы внутренней среды в рискованной деятельности организации.</p> <p>22. Среда прямого воздействия на организацию.</p> <p>23. Среда косвенного воздействия на организацию.</p> <p>24. Идентификация и анализ хозяйственного риска.</p> <p>25. Методы выявления хозяйственных рисков: сущность и характеристика.</p>
Анализ рисков	<p>1. Качественный анализ хозяйственных рисков.</p> <p>2. Количественный анализ хозяйственных рисков.</p> <p>3. Зоны хозяйственного риска.</p> <p>4. Построение кривой риска организации.</p> <p>5. Пороговые значения риска.</p> <p>6. Показатели степени риска.</p> <p>7. Экономико-статистические методы оценки риска.</p> <p>8. Метод экспертных оценок анализа хозяйственного риска. 34. Основные понятия и показатели оценки эффективности инвестиций. 35. Анализ степени риска реализации инвестиционных проектов. 36. Методы анализа риска инвестиционных проектов.</p> <p>9. Риск инвестирования в отдельный актив.</p> <p>10. Риск инвестиционного портфеля.</p> <p>11. Модель увязки систематического риска и доходности ценных бумаг САРМ (Capital Asset Pricing Model).</p> <p>12. Методы анализа риска инвестиционного портфеля.</p> <p>13. Анализ корреляционной зависимости финансовых активов в портфеле ценных бумаг.</p> <p>14. Сущность и содержание риск-менеджмента.</p> <p>15. Понятие, цель и задачи риск-менеджмента.</p> <p>16. Управление хозяйственным риском.</p> <p>17. Этапы управления хозяйственным риском.</p> <p>18. Методы управления рисками.</p> <p>19. Основные правила менеджмента риска.</p> <p>20. Методы уклонения от риска.</p> <p>21. Методы компенсации риска.</p> <p>22. Методы финансирования рисков (покрытия убытков).</p> <p>23. Принятие решения о выборе метода управления риском.</p> <p>24. Покрытие убытков на основе страхования.</p> <p>25. Содержание и виды страхования.</p> <p>26. Основные понятия в страховом деле.</p> <p>27. Способы определения суммы страхового возмещения.</p> <p>28. Понятие франшизы, ее виды, порядок применения.</p> <p>29. Имущественное страхование.</p> <p>30. Основные показатели в страховании.</p> <p>31. Определение экономического ущерба вследствие простоев производства.</p> <p>32. Страхование финансовых рисков.</p> <p>33. Хеджирование рисков.</p> <p>34. Система управления хозяйственными рисками в организации.</p> <p>35. Основные элементы эффективной системы управления рисками в организации.</p> <p>36. Организационная структура системы управления рисками в организации.</p> <p>37. Разработка программы управления рисками.</p> <p>38. Реализация программы управления рисками.</p> <p>39. Страхование предпринимательских рисков.</p> <p>40. Страхование ответственности.</p> <p>41. Оценка риска и выбор управленческих решений.</p>



**6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации****Шкала и критерии оценивания**

<b>Оценка</b>	<b>Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы</b>
<b>«зачтено»</b>	ОК8з1, ОК8у1, ОК8в1, ПК34з1, ПК34у1, ПК34в1, ПК36з1, ПК36у1, ПК36в1
<b>«не зачтено»</b>	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне