

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Костина Лариса Николаевна  
Должность: проректор  
Дата подписания: 2023.04.27  
Уникальный программный ключ:  
1800f7d89cf4ea7507265ba593fe87537eb15a6c

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ**  
**УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**  
**"ДОНЕЦКАЯ АКАДЕМИЯ УПРАВЛЕНИЯ И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ"**

**Факультет**

**Стратегического управления и международного бизнеса**

**Кафедра**

**Менеджмента внешнеэкономической деятельности**

**"УТВЕРЖДАЮ"**

Проректор

\_\_\_\_\_ Л.Н. Костина

27.04.2023 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

**Б1.В.ДВ.01.01**

**"Риск-менеджмент (на англ. яз.)"**

**Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент**

**Профиль "Международный менеджмент (с частичной реализацией на английском языке)"**

Квалификация

***МАГИСТР***

Форма обучения

***очная***

Общая трудоемкость

***3 ЗЭТ***

Год начала подготовки по учебному плану

***2023***

Донецк  
2023

**Составитель:**

*канд. экон. наук, доцент*

\_\_\_\_\_ Ю.А. Мишина

**Рецензент:**

*канд. экон. наук, доцент*

\_\_\_\_\_ Е.И. Кулик

Рабочая программа дисциплины (модуля) составлена на основании учебного плана

Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент

Профиль "Международный менеджмент (с частичной реализацией на английском языке)", утвержденного Ученым советом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС" от 27.04.2023 протокол № 12.

Срок действия программы: 2024-2025

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Менеджмента внешнеэкономической деятельности

Протокол от от 19.04.2023 г. № 17

Заведующий кафедрой:

д-р экон.наук, доцент, Беганская И.Ю.

\_\_\_\_\_  
(подпись)

---

**Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году****"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2024 - 2025 учебном году на заседании кафедры Менеджмента внешнеэкономической деятельности

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2024 г. № \_\_

Зав. кафедрой д-р экон.наук доцент Беганская И Ю

\_\_\_\_\_  
(подпись)

---

**Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году****"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2025 - 2026 учебном году на заседании кафедры Менеджмента внешнеэкономической деятельности

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2025 г. № \_\_

Зав. кафедрой д-р экон.наук, доцент, Беганская И.Ю.

\_\_\_\_\_  
(подпись)

---

**Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году****"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2026 - 2027 учебном году на заседании кафедры Менеджмента внешнеэкономической деятельности

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2026 г. № \_\_

Зав. кафедрой д-р экон.наук доцент Беганская И Ю

\_\_\_\_\_  
(подпись)

---

**Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году****"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2027 - 2028 учебном году на заседании кафедры Менеджмента внешнеэкономической деятельности

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2027 г. № \_\_

Зав. кафедрой д-р экон.наук, доцент, Беганская И.Ю.

\_\_\_\_\_  
(подпись)

## РАЗДЕЛ 1. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ

<b>1.1. ЦЕЛИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
обеспечение фундаментальной и практической профессиональной подготовки обучающихся в области теории и практики управления рисками, а также освоения методами оценки результативности системы управления рисками.	
<b>1.2. УЧЕБНЫЕ ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
обучить приемам оценки внешней и внутренней среды предприятия; усвоение обучающимися системы неопределенностей, сущности и функций рисков. изучение видов потерь и факторов риска, видов рисков; усвоение обучающимися технологии управления стратегическими и оперативными рисками.	
<b>1.3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОСНОВНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ</b>	
Цикл (раздел) ОПОП ВО:	Б1.В.ДВ.01
<i>1.3.1. Дисциплина "Риск-менеджмент (Risk management)" опирается на следующие элементы ОПОП ВО:</i>	
Современный стратегический анализ	
Управление изменениями	
Управленческая экономика	
<i>1.3.2. Дисциплина "Риск-менеджмент (Risk management)" выступает опорой для следующих элементов:</i>	
Таможенно-логистическое сопровождение ВЭД (Customs and logistics support of FEA)	
Международные кредитно-расчетные, валютные и страховые операции	
<b>1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:</b>	
<i>ПК-4.4: Демонстрирует навыки диагностирования, классификации, оценки рисков предприятия, использования инструментов риск-менеджмента.</i>	
Знать:	
<b>Уровень 1</b>	принципы и правила выбора метода, техники идентификации риска (достаточность ресурсов, характер и степень неопределенности, сложность метода, техники)
<b>Уровень 2</b>	возможности инструментов риск-менеджмента для идентификации рисков организации
<b>Уровень 3</b>	базовые положения международных стандартов по риск-менеджменту и смежным вопросам
Уметь:	
<b>Уровень 1</b>	определять контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения
<b>Уровень 2</b>	осуществлять оценку рисков ситуаций, с учетом отраслевой специфики и контекста функционирования организации
<b>Уровень 3</b>	идентифицировать и анализировать изменения рисков в динамике, включая маловероятные и случайные
Владеть:	
<b>Уровень 1</b>	навыком определения ситуации (контекста) рисков видов, сфер деятельности организации
<b>Уровень 2</b>	навыком мониторинга рисков по функциональным сферам и процессам деятельности организации
<b>Уровень 3</b>	навыком осуществления качественной оценки рисков посредством формирования реестра и на его основе построение карт, диаграмм для визуализации рисков
<b>1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:</b>	
<i>ПК-4.5: Применяет методы управления рисками, методики их расчета, оценивает эффективность проводимых мероприятий по минимизации рисков.</i>	
Знать:	
<b>Уровень 1</b>	базовые категории теории стратегического менеджмента и маркетинга
<b>Уровень 2</b>	ключевые процессы организации и сфере управления рисками
<b>Уровень 3</b>	современный международный и национальный опыт профессиональной деятельности риск-менеджера
Уметь:	

<b>Уровень 1</b>	устанавливать и поддерживать деловые контакты, связи, отношения с сотрудниками и заинтересованными сторонами по вопросам управления рисками
<b>Уровень 2</b>	определять наиболее важные для функционирования организации (социально-экономической системы) направления, технические и социально-экономические процессы
<b>Уровень 3</b>	определять стратегические цели и мероприятия с учетом рисков
Владеть:	
<b>Уровень 1</b>	навыком разработки и экспертизы стратегий и политик организации по управлению рисками на различных уровнях
<b>Уровень 2</b>	навыком определения приоритетных направлений и сферы деятельности, подверженных наибольшему риску
<b>Уровень 3</b>	навыком отбора проектов, выносимых на обсуждение коллегиального органа управления рисками и коллегиального органа управления

**В результате освоения дисциплины "Риск-менеджмент (на англ.яз.)" обучающийся должен:**

<b>3.1 Знать:</b>	основные понятия, концепции и методы теории управления рисками; понятия «среды принятия решений»; сущность риска и неопределенности в процессах принятия решений, критерии принятия рискованного решения, классификационные схемы видов риска в деятельности финансовых и нефинансовых организациях
<b>3.2 Уметь:</b>	использовать методики анализа и оценки риска финансово-хозяйственной деятельности предприятий и организаций; анализировать и прогнозировать рыночный и специфические риски предприятия в зависимости от объема и достоверности имеющейся информации о финансово-хозяйственной деятельности предприятий и организаций
<b>3.3 Владеть:</b>	специальной терминологией и лексикой данной дисциплины; навыками моделирования рискованных ситуаций, системой практических приемов и навыков, обеспечивающих сохранение и укрепление знаний, полученных в результате изучения дисциплины «Риск-менеджмент»

### 1.5. ФОРМЫ КОНТРОЛЯ

Текущий контроль успеваемости позволяет оценить уровень сформированности элементов компетенций (знаний, умений и приобретенных навыков), компетенций с последующим объединением оценок и проводится в форме: устного опроса на лекционных и семинарских/практических занятиях (фронтальный, индивидуальный, комплексный), письменной проверки (тестовые задания, контроль знаний по разделу, ситуационных заданий и т.п.), оценки активности работы обучающегося на занятии, включая задания для самостоятельной работы.

#### Промежуточная аттестация

Результаты текущего контроля и промежуточной аттестации формируют рейтинговую оценку работы обучающегося. Распределение баллов при формировании рейтинговой оценки работы обучающегося осуществляется в соответствии с действующим локальным нормативным актом. По дисциплине "Риск-менеджмент (на англ.яз.)" видом промежуточной аттестации является Зачет с оценкой

## РАЗДЕЛ 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

### 2.1. ТРУДОЕМКОСТЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоёмкость дисциплины "Риск-менеджмент (на англ.яз.)" составляет 3 зачётные единицы, 108 часов.

Количество часов, выделяемых на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающегося, определяется учебным планом.

### 2.2. СОДЕРЖАНИЕ РАЗДЕЛОВ ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Примечание
Section 1. Theoretical and methodological foundations of risk management						
1.1. Theoretical foundations of risk	4	4	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2	0	

management /Лек/				Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2		
1.1. Theoretical foundations of risk management /Сем зан/	4	4	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
1.1. Theoretical foundations of risk management /Ср/	4	8	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
1.2. Risk management methodology /Лек/	4	2	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
1.2. Risk management methodology /Сем зан/	4	2	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
1.2. Risk management methodology /Ср/	4	7	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
1.3. Process approach to risk management /Лек/	4	2	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
1.3. Process approach to risk management /Сем зан/	4	2	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2	0	

				Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2		
1.3. Process approach to risk management /Ср/	4	7	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
<b>Section 2. Risk-forming events and risk identification</b>						
2.1. Identification of risk-generating events /Лек/	4	4	ПК-4.5	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
2.1. Identification of risk-generating events /Сем зан/	4	4	ПК-4.5	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
2.1. Identification of risk-generating events /Ср/	4	7	ПК-4.5	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
2.2. Risk identification and analysis /Лек/	4	2	ПК-4.5	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
2.2. Risk identification and analysis /Сем зан/	4	2	ПК-4.5	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
2.2. Risk identification and analysis /Ср/	4	7	ПК-4.5	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4	0	

				Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2		
<b>Section 3. Monitoring and specific methods of risk management</b>						
3.1.Control and ways to respond to risks /Лек/	4	4	ПК-4.5	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
3.1.Control and ways to respond to risks /Сем зан/	4	4	ПК-4.5	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
3.1.Control and ways to respond to risks /Ср/	4	7	ПК-4.5	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
3.2.Organization risk management monitoring /Лек/	4	2	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
3.2.Organization risk management monitoring /Сем зан/	4	2	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
3.2.Organization risk management monitoring /Ср/	4	7	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	

3.3.Specific risk management techniques /Лек/	4	4	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
3.3.Specific risk management techniques /Сем зан/	4	4	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
3.3.Specific risk management techniques /Ср/	4	8	ПК-4.4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2	0	
/Конс/	4	2			0	

### РАЗДЕЛ 3. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

<p>3.1 В процессе освоения дисциплины "Риск-менеджмент (на англ. яз.) используются следующие образовательные технологии: лекции (Л), семинарские занятия (СЗ), самостоятельная работа обучающегося (СР) по выполнению различных видов заданий.</p> <p>3.2 В процессе освоения дисциплины "Риск-менеджмент (на англ.)" используются следующие интерактивные образовательные технологии: проблемная лекция (ПЛ). Лекционный материал представлен в виде слайд- презентации в формате «Power Point». Для наглядности используются материалы различных научных и технических экспериментов, справочных материалов, научных статей т.д. В ходе лекции предусмотрена обратная связь с обучающимся, активизирующие вопросы, просмотр и обсуждение видеофильмов. При проведении лекций используется проблемно-ориентированный междисциплинарный подход, предполагающий творческие вопросы и создание дискуссионных ситуаций.</p> <p>При изложении теоретического материала используются такие методы, как: монологический, показательный, диалогический, исследовательский, проблемное изложение, а также следующие принципы дидактики высшей школы, такие как: последовательность и систематичность обучения, доступность обучения, принцип научности, принципы взаимосвязи теории и практики, наглядности и др. В конце каждой лекции предусмотрено время для ответов на проблемные вопросы.</p> <p>3.3 Самостоятельная работа предназначена для внеаудиторной работы обучающихся, связанной с конспектированием источников, учебного материала, изучением дополнительной литературы по дисциплине, подготовкой к текущему и семестровому контролю, а также выполнением индивидуального задания в форме реферата, эссе, презентации, эмпирического исследования.</p>
--

### РАЗДЕЛ 4. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

4.1. Рекомендуемая литература			
1. Основная литература			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л1.1		Корпоративный риск-менеджмент: учебно–	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС",

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
	Л. М. Волощенко, Е. Ю. Афондикова	методическое пособие (185 с.)	2016
Л1.2	И. П. Хоминич [и др.]	Управление финансовыми рисками. Практикум: учебное пособие для вузов (129 с.)	Москва : Издательство Юрайт, 2021
Л1.3	Т. В. Денисова	Управление финансовыми рисками : учебное пособие (192 с.)	Ульяновск : УлГТУ, 2021
Л1.4	Гончарова, М. В., Тарасова, Е. В., Чернобаева, С. В., Смелянская, М. Е., Мишина, Ю. А.	Риск–менеджмент = Risk management : учебно-методическое пособие для обучающихся 1 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 «Менеджмент» (магистерская программа «Международный менеджмент» (с частичной реализацией на английском языке) очной формы обучения (217 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2021
Л1.5	Тарасова, Е. В.	Риск - менеджмент: учебно-методическое пособие для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (магистерские программы: «Менеджмент организаций», «Стратегическое управление») очной / заочной форм обучения (170 с.)	Донецк : ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2022

## 2. Дополнительная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Ронда, Абрамс	Бизнес-план на 100%: стратегия и тактика эффективного бизнеса (496 с.)	Москва : Альпина Паблишер, 2019
Л2.2	Канев, В.С	Исчисление рисков: практикум по курсу «Теория риска и моделирование рисков ситуаций» (задачи, упражнения, примеры, РГЗ, тесты и кейсы) (53 с.)	Новосибирск : Сибирский государственный университет телекоммуникаций и информатики, 2020
Л2.3	И. Ю. Беганская, Е. В. Тарасова, М. В. Гончарова, М. Е. Смелянская	Антикризисное управление и банкротство в международном бизнесе: учебно-методическое пособие для обучающихся 1 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (магистерская программа «Организационно-правовое регулирование в международном бизнесе») очной формы обучения (213)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2021

## 3. Методические разработки

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Таскаева, Н. Н., Прохорова, Ю. С.	Антикризисное управление и риск-менеджмент : учебно-методическое пособие (47 с.)	Москва : Издательство МИСИ – МГСУ, 2020
Л3.2	Ю.А. Мишина	Риск-менеджмент (на английском языке): конспект лекций для обучающихся 1 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (профиль «Международный менеджмент (с частичной реализацией на английском языке)» очной формы обучения (166 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2023
Л3.3	Ю.А. Мишина	Риск-менеджмент (на английском языке): методические рекомендации для проведения семинарских занятий для обучающихся 1 курса образовательной программы магистратуры	Донецк: ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2023

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
		направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (профиль «Международный менеджмент (с частичной реализацией на английском языке)) очной формы обучения (46 с.)	
ЛЗ.4	Ю.А. Мишина	Риск-менеджмент (на английском языке): методические рекомендации по организации самостоятельной работы обучающихся 1курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (профиль «Международный менеджмент (на английском языке)) очной формы обучения (69 с.)	Донецк: ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2023
ЛЗ.5	Ю.А. Мишина	Риск-менеджмент (на английском языке): методические рекомендации по выполнению индивидуальной работы обучающихся 1курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (профиль «Международный менеджмент» (с частичной реализацией на английском языке) очной формы обучения (9 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2023

#### 4.2. Перечень ресурсов

##### информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

Э1	Электронно-библиотечная система ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС»	<a href="https://glib.donampa.ru/greenstone3/library/">https://glib.donampa.ru/greenstone3/library/</a>
Э2	Электронно-библиотечная система ЭБС Лань	<a href="https://e.lanbook.com/">https://e.lanbook.com/</a>

#### 4.3. Перечень программного обеспечения

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства:

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства:

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства:

Компьютерная техника с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду (ЭИОС ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС") и электронно-библиотечную систему (ЭБС IPRbooks), а также возможностью индивидуального неограниченного доступа обучающихся в ЭБС и ЭИОС посредством Wi-Fi с персональных мобильных устройств.

Сервер: AMD FX 8320/32Gb(4x8Gb)/4Tb(2x2Tb). На сервере установлена свободно распространяемая операционная система DEBIAN 10. MS Windows 8.1 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК ), MS Windows XP (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК ), MS Windows 7 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК ), MS Office 2007 Russian OLP NL AE (лицензии Microsoft № 42638778, № 44250460), MS Office 2010 Russian (лицензии Microsoft № 47556582, № 49048130), MS Office 2013 Russian (лицензии Microsoft № 61536955, № 62509303, № 61787009, № 63397364), Grub loader for ALT Linux (лицензия GNU LGPL v3), Mozilla Firefox (лицензия MPL2.0), Moodle (Modular Object-Oriented Dynamic Learning Environment, лицензия GNU GPL), IncScape (лицензия GPL 3.0+), PhotoScape (лицензия GNU GPL), 1С ERP УП, 1С ЗУП (бесплатные облачные решения для образовательных учреждений от 1Сfresh.com). OnlyOffice 10.0.1 (SeeS, GNU Affero General Public License3)

#### 4.4. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Электронно-библиотечная система ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС"» - <https://glib.donampa.ru/greenstone3/library/>  
Внешняя ЭБС - Электронно-библиотечная система Лань - <https://e.lanbook.com/>

#### 4.5. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа, групповых и консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации: лекционная аудитория № 206 учебный корпус № 2. – комплект мультимедийного оборудования: ноутбук, мультимедийный проектор, экран; - специализированная мебель: рабочее место преподавателя, рабочие места обучающихся (42), стационарная доска, выкатная, доска, Windows 8.1 Professional x86/64

(академическая подписка DreamSpark Premium), LibreOffice 4.3.2.2 (лицензия GNU LGPL v3+ и MPL2.0).  
 Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, групповых и консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации: №206 учебный корпус №2.  
 - специализированная мебель: рабочее место преподавателя, рабочие места обучающихся (60), стационарная доска, демонстрационные плакаты;  
 Помещения для самостоятельной работы с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно образовательную среду организации:  
 читальные залы, учебные корпуса 1, 6. Адрес: г. Донецк, ул. Челюскинцев 163а, г. Донецк, ул. Артема 94.

## РАЗДЕЛ 5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

### 5.1. Контрольные вопросы и задания

1. Перечислите основные условия возникновения рисков в деятельности организации.
2. Что понимается под риском в бизнесе?
3. Каким образом инновационная функция риска способствует дальнейшему развитию организации?
4. Выделите характеристики объективного и субъективного понимания риска.
5. Перечислите внешние факторы источников возникновения рисков.
6. Что называют ценой риска?
7. Как можно определить объективные факторы влияния на экономическую деятельность?
8. Назовите основные структурные характеристики риска.
9. Чему призваны служить основные методы управления рисками? Перечислите их.
10. Назовите плюсы и минусы методов страхования и резервирования. В каких случаях какой из них более приемлем?
11. Какое место в системе управления рисками занимают методы материального стимулирования? В чем их суть?
12. Роль корпоративной культуры в менеджменте очевидна. А как влияет корпоративная культура на готовность к риску в организации?
13. По каким основаниям гражданско – правовые методы управления рисками отличаются от административно – правовых?
14. В чем состоит сущность процессного подхода к управлению рисками?
15. Дайте определение технологии управления.
16. На какие группы подразделяются функции управления рисками в зависимости от их продолжительности во времени?
17. Что такое системный анализ в управлении рисками?
18. Что понимается под идентификацией и анализом рисков?
19. В чем заключается специфика этапа идентификации рисков?
20. Перечислите ряд общих процедур по минимизации последствий риска.
21. Для чего предназначен этап выбора методов управления рисками?
22. В какой области решения по принятию рисков являются первоочередными?
23. Что предполагает этап исполнения выбранного метода управления риском?
24. Как обеспечивает гибкость и адаптивность управления риском этап мониторинга?
25. Почему приходится сопоставлять реальные расходы с гипотетическими потерями в управлении рисками?
26. Что является целью оценки эффективности проведенных мероприятий?
27. Какова задача этапа осмысления рисков?
28. Дайте общую характеристику концепции приемлемого риска.
29. Как традиции организации и корпоративная культура влияют на определение степени приемлемости риска?
30. Какие методы сбора и анализа информации используются при идентификации риска?
31. Какие этапы можно выделить в процессе идентификации и анализа рисков?
32. Дайте определение программы определения рисками.
33. Какая главная проблема при оценивании рискованного капитала?
34. По каким признакам классифицируются методы управления рисками?
35. В каких случаях следует отказаться от риска?
36. Чему способствует создание программы превентивных мероприятий в рисковом менеджменте?
37. Каким образом дифференциация рисков снижает размер ущерба?
38. Что означает метод аутсорсинга риска?
39. Как частота наступления убытков влияет на применение метода покрытия ущерба из текущего дохода?
40. В чем заключается недостаток создания резервного фонда в организации?
41. Для организаций какого типа эффективно создание кэптивных страховых компаний? В чем их назначение?
42. Как создается резервный фонд?

- 44 Что является основными инструментами административного контроля?  
 45 Каков механизм влияния косвенных факторов на эффективность управления рисками?  
 46 В чем состоит сущность планирования рисков?  
 47 Назовите основные виды методов мотивации и их вероятные последствия в системе риск-менеджмента.  
 48 Что является основными составляющими мониторинга?  
 49 Каким образом внешние и внутренние ограничения влияют на риск-менеджмент?  
 50 Перечислите основные задачи мониторинга управления рисками в малом бизнесе  
 51 Чем отличается деловая стратегия риск-менеджмента от функциональной?  
 52 Объясните различия в подходах к конкурентной стратегии организации.  
 53 Раскройте особенности порядка проведения мониторинга.

## 5.2. Темы письменных работ

### ПЕРЕЧЕНЬ ТЕМ ДОКЛАДОВ, СООБЩЕНИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

#### РАЗДЕЛ 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

##### Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками

1. Становление риск-менеджмента.
2. Классификация рисков.
3. Риск-менеджмент как отрасль научного управления.
4. Матрица риска.

##### Тема 1. 2. Методология управления рисками

1. Классификация методов управления, обусловленная их содержанием.
2. Сущность уголовно-правовых, административно-правовых, гражданско-правовых методов.
3. Метод компенсации, спекулирования, стимулирования, сдерживания.
4. Охарактеризовать организационные, распорядительные и дисциплинарные методы.
5. Три основные направления в рамках социального управления.

##### Тема 1. 3. Процессный подход к управлению рисков

1. 1. Метод постепенного приближения.
2. Дерево целей.
3. Построение рациональной системы организации.
4. Формирование оптимальной структуры организации.
5. Обеспечение организации всеми необходимыми ресурсами (финансовыми, человеческими, материальными, энергетическими и др.).

#### РАЗДЕЛ 2. РИСКООБРАЗУЮЩИЕ СОБЫТИЯ И ИДЕНТИФИКАЦИЯ РИСКОВ

##### Тема 2.1. Определение рискообразующих событий

1. Понятие рискообразующих факторов.
2. Основные принципы классификации рискообразующих факторов.
3. Рискообразующие факторы и комплексный подход к исследованию рисков.
4. Интегральные рискообразующие факторы.
5. Методы анализа рисков.

##### Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков

1. Понятие рискового капитала.
2. Пороговое значение риска.

#### РАЗДЕЛ 3. МОНИТОРИНГ И КОНКРЕТНЫЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

##### Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски

1. Уклонение и сокращение риска.
2. Перераспределение риска.

##### Тема 3.2. Мониторинг управления рисками организации

1. Текущий, оперативный и стратегический мониторинг.
2. Виды информации. Оперативная информация как средство мониторинга рисков.

##### Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками

1. Методы трансформации рисков.
2. Метод отказа от риска.
3. Методы финансирования рисков.

Темы рефератов по разделам

#### РАЗДЕЛ 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

##### Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками

##### Тема 1. 2. Методология управления рисками

1. Западный опыт в области управления риском.
2. Механизм формирования принципов риск-менеджмента
3. Основа аксиоматики риск-менеджмента.
4. Подходы к классификации законов управления.
5. Формирование реальной власти и лидерства в организации.
6. Рационализация формальной и неформальной структуры трудового коллектива.
7. Создание и развитие единой корпоративной культуры.
8. Особенности применения психологических методов управления рисками.
9. Производственные методы риск-менеджмента.
10. Использование научно-прикладных методов управления в системе риск-менеджмента.
11. Пирамида потребностей Маслоу.
12. Система регулирования деятельности организации.
13. Конструктивные и деструктивные цели.
14. Контроллинг, как новое направление контрольной деятельности.
15. Управленческий учет в системе управления.

## РАЗДЕЛ 2. РИСКООБРАЗУЮЩИЕ СОБЫТИЯ И ИДЕНТИФИКАЦИЯ РИСКОВ

Тема 2.1. Определение рискообразующих событий

Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков

1. Методы снижения рисков.
2. Сокращение возможных потерь.
3. Методы передачи риска.
4. Схемы переноса риска.
5. Визуализация рисков.
6. Основные принципы оценки рисков.
7. Этапы управления рисками.
8. Концепция приемлемого риска.

## РАЗДЕЛ 3. МОНИТОРИНГ И КОНКРЕТНЫЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски

Тема 3.2. Мониторинг управления рисками организации

Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками

1. Современные средства контроля и реагирования на возникающие риски.
2. Примеры применения систем контроля рисков на предприятиях.
3. Современные средства коммуникации, применяемые для мониторинга возникновения рисков.
4. Виды и этапы мониторинга рисков.
5. Дополнительные средства, применяемые для мониторинга рисков.
6. Методики расчетов финансовых рисков.
7. Понятие и применение «нестрахового» пула.

### 5.3. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств дисциплины "Риск-менеджмент (Risk management)" разработан в соответствии с локальным нормативным актом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС".

Фонд оценочных средств дисциплины "Риск-менеджмент (Risk management)" в полном объеме представлен в виде приложения к данному РПД.

### 5.4. Перечень видов оценочных средств

Собеседование,  
расчетно-аналитические задания,  
доклад, сообщение,  
индивидуальное задание,  
контроль знаний по разделам учебной дисциплины,  
научная составляющая

## РАЗДЕЛ 6. СРЕДСТВА АДАПТАЦИИ ПРЕПОДАВАНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ К ПОТРЕБНОСТЯМ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

В случае необходимости, обучающимся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья (по заявлению обучающегося) могут предлагаться одни из следующих вариантов восприятия информации с учетом их индивидуальных психофизических особенностей:

- 1) с применением электронного обучения и дистанционных технологий.

2) с применением специального оборудования (техники) и программного обеспечения, имеющихся в ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС".

В процессе обучения при необходимости для лиц с нарушениями зрения, слуха и опорно-двигательного аппарата предоставляются следующие условия:

- для лиц с нарушениями зрения: учебно-методические материалы в печатной форме увеличенным шрифтом; в форме электронного документа; в форме аудиофайла (перевод учебных материалов в аудиоформат); индивидуальные задания и консультации.

- для лиц с нарушениями слуха: учебно-методические материалы в печатной форме; в форме электронного документа; видеоматериалы с субтитрами; индивидуальные консультации с привлечением сурдопереводчика; индивидуальные задания и консультации.

- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата: учебно-методические материалы в печатной форме; в форме электронного документа; в форме аудиофайла; индивидуальные задания и консультации.

## **РАЗДЕЛ 7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО УСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ**

Изучение дисциплины осуществляется по следующим формам: лекции, семинарские занятия и самостоятельная (в том числе индивидуальная) работа обучающегося. Важным условием для освоения дисциплины в процессе занятий является ведение конспектов, освоение и осмысление терминологии изучаемой дисциплины. Материалы лекционных занятий следует своевременно подкреплять проработкой соответствующих разделов в учебниках, учебных пособиях, научных статьях и монографиях, в соответствии со списком основной и дополнительной литературы. Дополнительная проработка изучаемого материала проводится во время семинарских занятий, в ходе которых анализируются и закрепляются основные знания, полученные по дисциплине.

При подготовке к семинарским занятиям следует использовать основную и дополнительную литературу из представленного списка. На семинарских занятиях приветствуется активное участие в обсуждении конкретных ситуаций, способность на основе полученных знаний находить наиболее эффективные решения поставленных проблем, уметь находить полезный дополнительный материал по тематике семинарских занятий. В рамках изучения учебной дисциплины необходимо использовать передовые информационные технологии – компьютерную технику, электронные базы данных, Интернет. Целями самостоятельной работы обучающегося является: систематизация и закрепление полученных теоретических знаний и практических умений; углубление и расширение теоретических знаний; формирование умения использовать справочную литературу; формирование самостоятельности мышления, способностей к саморазвитию, самосовершенствованию и самореализации; развитие исследовательских умений. Самостоятельная (в том числе индивидуальная) работа выполняется обучающимся по заданию преподавателя, в соответствии с Фондом оценочных средств дисциплины и содержит следующие задания: для подготовки к устному опросу – изучение программного материала дисциплины (работа с учебником и конспектом лекции, изучение рекомендуемых литературных источников, конспектирование источников); для выполнения ситуационных заданий – анализ деловых ситуаций; для подготовки и написания реферата – работа с электронными информационными ресурсами и ресурсами Internet (использование аудио- и видеозаписи); для проведения контроля знаний по разделам учебной дисциплины – подведение промежуточных и текущих итогов; Изучение дисциплины предполагает форму промежуточной аттестации – зачет с оценкой.

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«ДОНЕЦКАЯ АКАДЕМИЯ УПРАВЛЕНИЯ И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ»**

**Факультет Стратегического управления и международного бизнеса  
Кафедра Менеджмента внешнеэкономической деятельности**

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

по дисциплине (модулю) «Риск – менеджмент (на англ. яз.)»

Направление подготовки	38.04.02 Менеджмент
Профиль	«Международный менеджмент (с частичной реализацией на английском языке)»
Квалификация	магистр
Форма обучения	очная

Донецк  
2023



**РАЗДЕЛ 1.**  
**ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**  
**по учебной дисциплине «Риск-менеджмент (на английском языке)»**

**1.1. Основные сведения об учебной дисциплине**

Таблица 1

Характеристика дисциплины (модуля)  
(сведения соответствуют разделу РПД)

Образовательная программа	Магистратура
Направление подготовки	38.04.02 Менеджмент
Профиль	«Международный менеджмент» (с частичной реализацией на английском языке)
Количество разделов учебной дисциплины	3
Часть образовательной программы	Часть, формируемая участниками образовательных отношений (Б1.В.ДВ.01.)
Формы контроля	Собеседование, расчетно – аналитические задания, доклад, сообщение, контроль знаний по разделам учебной дисциплины; научная составляющая, индивидуальное задание
Показатели	Очная форма обучения
Количество зачетных единиц (кредитов)	3
Год подготовки	2023/2024
Семестр	4
<b>Общая трудоемкость (академ. часов)</b>	108
<b>Аудиторная контактная работа:</b>	50
лекционные занятия	24
семинарские занятия	24
<b>Самостоятельная работа</b>	58
<b>Контроль</b>	2
Форма промежуточной аттестации	Зачет с оценкой

**1.2. Перечень компетенций с указанием этапов формирования в процессе освоения образовательной программы.**

Таблица 2

Перечень компетенций и их элементов

Код компетенции	Формулировка компетенции	Элементы компетенции	Индекс элемента
ПК-4.4.	Демонстрирует навыки диагностирования, классификации, оценки рисков предприятия, использования инструментов	Знать:	ПК-4.4 3-1
		1. принципы и правила выбора метода, техники идентификации риска (достаточность ресурсов, характер и степень неопределенности, сложность метода, техники);	
		2. возможности инструментов	ПК-4.4 3-2

Код компетенции	Формулировка компетенции	Элементы компетенции	Индекс элемента
	риск-менеджмента	<p>риск-менеджмента для идентификации рисков организации;</p> <p>3. базовые положения международных стандартов по риск-менеджменту и смежным вопросам.</p>	ПК-4.4 З-3
		<p>Уметь:</p> <p>1. определять контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения;</p>	ПК-4.4 У-1
		<p>2. осуществлять оценку рисковых ситуаций, с учетом отраслевой специфики и контекста функционирования организации;</p>	ПК-4.4 У-2
		<p>3. идентифицировать и анализировать изменения рисков в динамике, включая маловероятные и случайные.</p>	ПК-4.4 У-3
		<p>Владеть:</p> <p>1. навыком определения ситуации (контекста) рисковых видов, сфер деятельности организации;</p>	ПК-4.4 В-1
		<p>2. навыком мониторинга рисков по функциональным сферам и процессам деятельности организации;</p>	ПК-4.4 В-2
		<p>3. навыком осуществления качественной оценки рисков посредством формирования реестра и на его основе построение карт, диаграмм для визуализации рисков.</p>	ПК-4.4 В-3
ПК-4.5	Применяет методы управления рисками, методики их расчета, оценивает эффективность проводимых мероприятий по минимизации рисков	<p>Знать:</p> <p>1. базовые категории теории стратегического менеджмента и маркетинга;</p> <p>2. ключевые процессы организации и сфере управления рисками;</p> <p>3. современный международный и национальный опыт профессиональной деятельности риск-менеджера.</p>	<p>ПК-4.5 З-1</p> <p>ПК-4.5 З-2</p> <p>ПК-4.5З-3</p>

Код компетенции	Формулировка компетенции	Элементы компетенции	Индекс элемента
		<p>Уметь:</p> <p>устанавливать и поддерживать деловые контакты, связи, отношения с сотрудниками и заинтересованными сторонами по вопросам управления рисками;</p> <p>определять наиболее важные для функционирования организации (социально-экономической системы) направления, технические и социально-экономические процессы;</p> <p>определять стратегические цели и мероприятия с учетом рисков.</p>	<p>ПК-4.5 У-1</p> <p>ПК-4.5 У-2</p> <p>ПК-4.5У-3</p>
		<p>Владеть:</p> <p>1. навыком разработки и экспертизы стратегий и политик организации по управлению рисками на различных уровнях;</p> <p>2. навыком определения приоритетных направлений и сферы деятельности, подверженных наибольшим рискам</p> <p>3. навыком отбора проектов, выносимых на обсуждение коллегиального органа управления рисками и коллегиального органа управления.</p>	<p>ПК-4.5 В-1</p> <p>ПК-4.5 В-2</p> <p>ПК-4.5В-3</p>

Таблица 3

Этапы формирования компетенций в процессе освоения основной образовательной программы

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Этапы формирования компетенций (номер семестра)	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
<b>Section 1. Theoretical and methodological foundations of risk management</b>				
1.	Topic 1.1. Theoretical foundations of risk management	2	ПК-4.4 З-1 ПК-4.4 З-2 ПК-4.4 З-3 ПК-4.4 У-1 ПК-4.4 У-2 ПК-4.4 У-3 ПК-4.4 В-1 ПК-4.4 В-2 ПК-4.4 В-3	Собеседование, расчетно – аналитические задания, доклад, сообщение.
2.	Topic 1.2.Risk management methodology	2	ПК-4.4 З-1 ПК-4.4 З-2 ПК-4.4 З-3	Собеседование, расчетно – аналитические

			ПК-4.4 У-1 ПК-4.4 У-2 ПК-4.4 У-3 ПК-4.4 В-1 ПК-4.4 В-2 ПК-4.4 В-3	задания, доклад, сообщение.
3.	Topic 1.3. Process approach to risk management	2	ПК-4.4 З-1 ПК-4.4 З-2 ПК-4.4 З-3 ПК-4.4 У-1 ПК-4.4 У-2 ПК-4.4 У-3 ПК-4.4 В-1 ПК-4.4 В-2 ПК-4.4 В-3	Собеседование, тестирование, расчетно – аналитические задания, доклад, сообщение, контроль знаний по разделам учебной дисциплины.
<b>Section 2. Risk-forming events and risk identification</b>				
4.	Topic 2.1. Identification of risk-generating events	2	ПК-4.5 З-1 ПК-4.5 З-2 ПК-4.5 З-3 ПК-4.5 У-1 ПК-4.5 У-2 ПК-4.5 У-3 ПК-4.5 В-1 ПК-4.5 В-2 ПК-4.5 В-3	Собеседование, расчетно – аналитические задания, доклад, сообщение.
5.	Topic 2.2. Risk identification and analysis	2	ПК-4.5 З-1 ПК-4.5 З-2 ПК-4.5 З-3 ПК-4.5 У-1 ПК-4.5 У-2 ПК-4.5 У-3 ПК-4.5 В-1 ПК-4.5 В-2 ПК-4.5 В-3	Собеседование, тестирование, расчетно – аналитические задания, доклад, сообщение, контроль знаний по разделам учебной дисциплины.
<b>Section 3. Monitoring and specific methods of risk management</b>				
6.	Topic 3.1. Control and ways to respond to risks	2	ПК-4.5 З-1 ПК-4.5 З-2 ПК-4.5 З-3 ПК-4.5 У-1 ПК-4.5 У-2 ПК-4.5 У-3 ПК-4.5 В-1 ПК-4.5 В-2 ПК-4.5 В-3	Собеседование, расчетно – аналитические задания, доклад, сообщение.
7.	Topic 3.2. Organization risk management monitoring	2	ПК-4.4 З-1 ПК-4.4 З-2 ПК-4.4 З-3 ПК-4.4 У-1 ПК-4.4 У-2 ПК-4.4 У-3 ПК-4.4 В-1 ПК-4.4 В-2 ПК-4.4 В-3	Собеседование, расчетно – аналитические задания, доклад, сообщение.
8.	Topic 3.3. Specific risk management techniques	2	ПК-4.4 З-1 ПК-4.4 З-2 ПК-4.4 З-3	Собеседование, тестирование, расчетно –

			ПК-4.4 У-1 ПК-4.4 У-2 ПК-4.4 У-3 ПК-4.4 В-1 ПК-4.4 В-2 ПК-4.4 В-3	аналитические задания, доклад, сообщение, контроль знаний по разделам учебной дисциплины; научная составляющая, индивидуальное задание
--	--	--	--	--

## РАЗДЕЛ 2. Текущий контроль

Текущий контроль знаний используется для оперативного и регулярного управления учебной деятельностью (в том числе самостоятельной работой) обучающихся. В условиях балльно-рейтинговой системы контроля результаты текущего оценивания обучающегося используются как показатель его текущего рейтинга. Текущий контроль успеваемости осуществляется в течение семестра, в ходе повседневной учебной работы по индивидуальной инициативе преподавателя. Данный вид контроля стимулирует у обучающегося стремление к систематической самостоятельной работе по изучению учебной дисциплины.

### Распределение баллов по рейтинговой системе оценивания по видам учебной деятельности (очная форма обучения)

Сумма баллов по разделу	Раздел 1				Раздел 2			Раздел 3					
	Т. 1.1	Т. 1.2	Т. 1.3		Т. 2.1	Т. 2.2		Т. 3.1	Т. 3.2	Т. 3.3			
Темы				Контроль знаний раздела учебной дисциплины- 5			Контроль знаний раздела учебной дисциплины-5				Контроль знаний раздела учебной дисциплины-- 5	Научная составляющая - 10	Сумма баллов за дисциплину 100
Виды работ: Лекции													
Семинарские занятия (собеседование, решение расчетно – аналитических заданий)	6 3 3	6 3 3	6 3 3		6 3 3	6 3 3		6 3 3	6 3 3	6 3 3			
Индивидуальное задание	-				-			6*					
Самостоятельная работа (доклады, сообщения, презентации)	3	3	3		3	3		3	3	3			
Сумма баллов	27				15			38					

\* - Баллы за выполнение индивидуального задания и самостоятельной работы (реферат) выставляется в конце семестра после изучения всех тем учебной дисциплины «Режим свободных экономических зон»

*Научно-педагогический работник, ответственный за проведение всех видов занятий по конкретной дисциплине (модулю), сам распределяет баллы по видам работы исходя из 100-балльной системы.*

## 2.1. Рекомендации по оцениванию собеседования по вопросам для самоконтроля.

С целью контроля усвоения пройденного материала и определения уровня подготовленности обучающихся к изучению новой темы в начале каждого семинарского занятия преподавателем проводится индивидуальный или фронтальный устный опрос по выполненным заданиям предыдущей темы.

**Критерии оценивания устных ответов на контрольные вопросы для самоподготовки и описание шкалы оценивания**

Оценивание самостоятельной работы обучающихся  
(в том числе, ответов на контрольные вопросы для самоподготовки)

Максимальное количество баллов	Критерии
3 (отлично)	Обучающийся: 1) полно и аргументировано отвечает по содержанию вопроса; 2) обнаруживает понимание материала, может обосновать свои суждения, применить знания на практике, привести необходимые примеры; 3) излагает материал последовательно и правильно, с соблюдением исторической и хронологической последовательности.
2 (хорошо)	Обучающийся дает ответ, удовлетворяющий тем же требованиям, что и для оценки «Отлично», но допускает 1-2 ошибки, которые сам же исправляет.
1 (удовлетворительно)	Обучающийся обнаруживает знание и понимание основных положений данного задания, но: 1) излагает материал неполно и допускает неточности в определении понятий или формулировке правил; 2) не умеет достаточно глубоко и доказательно обосновать свои суждения и привести свои примеры; 3) излагает материал непоследовательно и допускает ошибки.
0* (неудовлетворительно)	Обучающийся обнаруживает незнание ответа на соответствующее задание, допускает ошибки в формулировке определений и правил, искажающие их смысл, беспорядочно и неуверенно излагает материал. Оценка «неудовлетворительно» отмечает такие недостатки в подготовке обучающегося, которые являются серьезным препятствием к успешному овладению последующим материалом.

## ТИПОВЫЕ ВОПРОСЫ ДЛЯ СОБЕСЕДОВАНИЯ ДЛЯ ПРОВЕРКИ УРОВНЯ КОМПЕТЕНЦИИ

### РАЗДЕЛ 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

#### Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками

1. Сущность риска в условиях неопределенности.
2. Причины возникновения рисков.
3. Основные структурные характеристики риска.
4. Основные аксиомы управления рисками.
5. Общие законы управления.
6. Специфические законы управления.

#### Тема 1.2. Методология управления рисками

1. Содержание основных тенденций к управлению рисками.
2. Основные методы риск-менеджмента.
3. Сущность юридических методов управления рисками.

4. Административные методы риск-менеджмента.
5. Экономические методы управления рисками.
6. Социальные методы управления рисками.

### **Тема 1. 3. Процессный подход к управлению рисков**

1. Понятие и сущность процессного подхода. Технология управления.
2. Планирование в системе риск-менеджмента.
3. Организационная функция управления рисками.
4. Мотивация как функция управления рисками.
5. Учет и контроль в системе управления рисками.
6. Оценка эффективности управления рисками.

## **РАЗДЕЛ 2. РИСКООБРАЗУЮЩИЕ СОБЫТИЯ И ИДЕНТИФИКАЦИЯ РИСКОВ**

### **Тема 2. 1. Определение рискообразующих событий**

1. Сущность понятия «событие». Факторы влияния.
2. Методы определения событий. Перечень событий.
3. Внутренний анализ. Пороговые значения или предупредительные сигналы.
4. Специализированные дискуссии и семинары. Анализ цепочки процесса. Основные индикаторы событий.
5. Методологии, основанные на анализе данных о событиях, связанных с убытками.

### **Тема 2. 2. Идентификация и анализ рисков**

1. Понятие идентификации рисков и её функции
2. Методы сбора и анализа информации при идентификации и анализе риска.
3. Оценка вероятности возникновения и влияния риска
4. Методы оценки рисков
5. Анализ рисков

## **РАЗДЕЛ 3. МОНИТОРИНГ И КОНКРЕТНЫЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ**

### **Тема 3. 1. Контроль и способы реагирования на риски**

1. Классификация средств контроля.
2. Выбор способа реагирования.
3. Контроль за функционированием информационных систем.
4. Выверочные средства контроля.

### **Тема 3. 2. Мониторинг управления рисками организации**

1. Сущность и виды мониторинга управления рисками.
2. Информационная инфраструктура и средства коммуникации.
3. Процесс проведения мониторинга.

### **Тема 3. 3. Конкретные методы управления рисками**

1. Подробность и своевременности информации как метод управления рисками.
2. Аутсорсинг риска.
3. Метод дифференциации рисков.

### **2.2 Рекомендации по оцениванию результатов расчетно – аналитических заданий** Оценивание решения обучающихся расчетно – аналитических заданий

Максимальное количество баллов	Критерии
3 (отлично)	<b>Балл «3»</b> выставляется, если задание решено правильно, дано развернутое пояснение и обоснование сделанного заключения. Обучающийся демонстрирует теоретические знания и аналитические способности, свободно владеет научной терминологией, способен при обосновании своего мнения свободно проводить аналогии между темами изучаемой дисциплины и смежных дисциплин.

2 (хорошо)	<b>Балл «2»</b> выставляется, если логика решения задания в основном правильная, однако имеют место значительные математические ошибки, обучающийся допускает неточности в выводах и при оперировании научной терминологией.
1 (удовлетворительно)	<b>Балл «1»</b> ставится, если задание решено при активной помощи преподавателя, обучающийся имеет ограниченные теоретические знания, допускает существенные ошибки при установлении логических взаимосвязей, а также при использовании научной терминологии.
0* (неудовлетворительно)	<b>Балл «0»</b> ставится, если задание решено неправильно, обсуждение и помощь преподавателя не привели к правильному заключению. Обнаруживает неспособность к построению самостоятельных заключений. Имеет слабые теоретические знания, не использует научную терминологию.

## РАСЧЕТНО – АНАЛИТИЧЕСКИЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ПРОВЕРКИ УРОВНЯ КОМПЕТЕНЦИИ

### РАЗДЕЛ 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

#### Тема 1. 2. Методология управления рисками

##### **Расчетно-аналитическое задание 1.**

Торговый агент предлагает предприятиям новый продукт. Из предыдущего опыта ему известно, что в среднем 1 из 65 клиентов, которым он предлагает товар, покупает его. В течение некоторого промежутка времени он предложил продукт 20 предприятиям. Чему равна вероятность того, что он продаст им хотя бы единицу товара?

##### **Расчетно-аналитическое задание 2.**

Инвестор планирует вложить средства в мясоперерабатывающие предприятия А и Б. Надежность первого оценивается экспертами на уровне 70 %, а второго – 85 %. Чему равна вероятность того, что: а) оба предприятия в течение года не станут банкротами? б) наступит хотя бы одно банкротство?

##### **Расчетно-аналитическое задание 3.**

Крупный концерн мясо-молочных предприятий намеревается реализовать акции дочерних предприятий А и Б. На основании статистических расчетов вероятность того, что акция А поднимется завтра в цене, равна 0,4. Вероятность того, что обе акции А и Б поднимутся завтра в цене, равна 0,18. Предположим, что известно, что акция А поднимется в цене завтра. Чему равна вероятность того, что и акция Б завтра поднимется в цене?

### РАЗДЕЛ 2. РИСКООБРАЗУЮЩИЕ СОБЫТИЯ И ИДЕНТИФИКАЦИЯ РИСКОВ

#### Тема 2.1. Определение рискообразующих событий

##### **Расчетно-аналитическое задание 1.**

Руководство предприятия планирует диверсифицировать свою деятельность и осуществить выпуск нового продукта. С этой целью необходимо принять решение в пользу одной из альтернатив: организовать отдельное производство для создания нового продукта, переоборудовать существующий цех или продать патент на новый продукт другому субъекту хозяйствования. Размер дохода, который организация может получить, зависит от состояния рынка, который может быть благоприятным с вероятностью 0,55 либо неблагоприятным с вероятностью 0,45. Размеры ожидаемого финансового результата всех трех альтернатив отражены в табл. 1. Определить оптимальное решение для предприятия.

Ожидаемый финансовый результат альтернативных решений

№ стратегии	Действие предприятия	Ожидаемый финансовый результат, у. е.	
		Благоприятное состояние рынка	Неблагоприятное состояние рынка
1	Отдельное производство	400000	-340000
2	Реконструкция цеха	200000	-40000
3	Продажа патента	20000	20000

**Порядок выполнения задания**

Задачу необходимо решать, используя критерий максимизации ожидаемого финансового результата.

1. Построить схему «дерева решений».
2. Рассчитать ожидаемый финансовый результат по каждому варианту по формуле математического ожидания:
3. По результатам работы сделать выводы.

**Расчетно-аналитическое задание 2.**

Пусть перед тем, как принимать решение, руководство предприятия должно определить, заказывать ли дополнительное исследование рынка или нет, причем, предоставляемая услуга обойдется организации в 20000 у. е. Причем, дополнительное исследование по-прежнему не способно дать точной информации, но оно поможет уточнить ожидаемые оценки конъюнктуры рынка, изменив тем самым значения вероятностей. Размеры ожидаемого финансового результата всех трех альтернатив отражены в таблице 1. Относительно организации, которой можно заказать выполнение маркетинговых исследований, известно, что она способна уточнить значения вероятностей благоприятного и неблагоприятного исходов. Например, когда организация утверждает, что рынок благоприятный, то с вероятностью 0,69 этот прогноз оправдывается, прогноз о неблагоприятном рынке оправдывается с вероятностью 0,76. Организация утверждает, что ситуация будет благоприятной с вероятностью 0,39 и неблагоприятной – с вероятностью 0,61. Следует ли субъекту хозяйствования, осуществляющему диверсификацию производства, заказывать дополнительное обследование рынка? Каков ожидаемый финансовый результат наилучшего решения?

**Порядок выполнения задания**

Задачу необходимо решать, используя критерий максимизации ожидаемого финансового результата.

1. Построить «дерево решений» аналогично задаче № 1, но добавить новый узел «заказывать ли маркетинговое исследование».
2. Рассчитать ожидаемый финансовый результат по каждому варианту по формуле математического ожидания.
3. По результатам работы сделать выводы.
4. Ответить на контрольные вопросы.

### РАЗДЕЛ 3. МОНИТОРИНГ И КОНКРЕТНЫЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

**Тема 3.2. Мониторинг управления рисками организации****Расчетно-аналитическое задание 1.**

По результатам качественного анализа выделены значимые факторы риска для организации (табл. 1). Каждому фактору хозяйственного риска соответствует одна из критических переменных (выручка, переменные и постоянные затраты, полная себестоимость продукции и др.), на которую данный фактор риска оказывает преобладающее влияние (см. табл. 1). Экспертные оценки возможного изменения критических переменных также представлены в таблице 2. Согласно финансовой отчетности организации за отчетный период, выручка от реализации продукции (принимается без косвенных налогов) составила 11000 тыс. руб., переменные затраты – 7900 тыс. руб., постоянные затраты – 1500 тыс. руб., стоимость сырья составляет 90% от переменных затрат. Средняя процентная ставка по кредитам для организации – 14 %.

Таблица 1

## Матрица чувствительности и предсказуемости

Предсказуемость	Эластичность		
	Высокая	Средняя	Низкая
Низкая	I	I	II
Средняя	I	II	III
Высокая	II	III	III

Таблица 2

## Взаимосвязь факторов хозяйственного риска организации с критическими переменными

Фактор риска	№ критической переменной	Влияние фактора риска на показатели деятельности предприятия (критические переменные)	Возможное изменение критического показателя, %
Производственный брак	1	Рост полной себестоимости	+5
Рост расходов на рекламу	2	Рост постоянных затрат	+35
Закупка сырья ненадлежащего качества	3	Рост переменных затрат	+10
Задержка платежей потребителями продукции и услуг	4	Снижение поступлений от выручки	-15
Сезонное снижение спроса на производимую продукцию и услуги	5	Снижение выручки от реализации продукции	-10

**Порядок выполнения задания**

1. Рассчитать прибыль предприятия при изменении критических переменных. Результаты расчета представить в форме таблицы 3.
2. Заполнить таблицу 4. Рассчитать показатели эластичности результативного показателя предприятия (прибыли).  
Результаты внести в графу 6 таблицы 4.

Таблица 3

## Результаты расчета прибыли предприятия при изменении критических переменных

Показатель	Фактическое значение за отчетный период, тыс. руб.	Перерасчет прибыли с учетом изменения критической переменной				
		1	2	3	4	5
1. Выручка от реализации продукции						
2. Переменные затраты						
3. Постоянные затраты						
4. Прибыль от реализации продукции						
5. Изменение прибыли по сравнению с фактическим значением, %						

## Расчет эластичности результативного показателя (прибыли) по факторам риска

Критические переменные	Изменение критической переменной, $\Delta x$ , %	Базовое значение прибыли, тыс. руб.	Новое значение прибыли, тыс. руб.	Изменение прибыли, $\Delta П$ , %	Эластичность прибыли	Рейтинг критических переменных
1	2	3	4	5	6	7
Рост полной себестоимости						
Рост постоянных затрат						
Рост переменных затрат						
Снижение поступлений от выручки						
Снижение выручки от реализации продукции						

3. Присвоить рейтинги для каждой критической переменной. Рейтинг 1 присваивается для показателя с наивысшей эластичностью прибыли. Результаты внести в графу 7 таблицы 4.

4. На основании полученных значений эластичности прибыли к изменению критических переменных составить карту риска организации, заполнив таблицу 5. В таблице 5 привести экспертные оценки степени эластичности прибыли и возможности прогнозирования значений показателей риска по категориям: «высокий», «средний» и «низкий».

Таблица 5

## Карта риска хозяйственной деятельности организации

Факторы риска	Эластичность прибыли	Оценка эластичности	Оценка возможности прогнозирования	Группа риска
Нарушение условий хранения готовой продукции				
Рост расходов на переподготовку персонала				
Повышение цен на сырье				
Несвоевременная оплата отгруженной продукции				
Неплатежеспособность клиентов				

На основании полученных данных и матрицы чувствительности и прогнозируемости (табл. 1) присвоить группу риска каждому фактору риска.

5. Сделать выводы.

## 2.3. Рекомендации по оцениванию докладов, сообщений.

Оценивание самостоятельной работы обучающихся  
(докладов, сообщений, презентаций)

Максимальное количество баллов	Критерии
3 (отлично)	Доклад содержит полную информацию по представляемой теме, основанную на обязательных литературных источниках и современных публикациях; выступление сопровождается качественным демонстрационным материалом (слайд-презентация, раздаточный материал); выступающий свободно владеет содержанием, ясно и грамотно излагает материал; свободно и корректно отвечает на вопросы и замечания аудитории; точно укладывается в рамки регламента (7 минут).
2 (хорошо)	Представленная тема раскрыта, однако доклад содержит неполную информацию по представляемой теме; выступление сопровождается демонстрационным материалом (слайд-презентация, раздаточный материал); выступающий ясно и грамотно излагает материал; аргументировано отвечает на вопросы и замечания аудитории, однако выступающим допущены незначительные ошибки в изложении материала и ответах на вопросы.
1 (удовлетворительно)	Обучающийся демонстрирует поверхностные знания по выбранной теме, имеет затруднения с использованием научно-понятийного аппарата и терминологии курса; отсутствует сопроводительный демонстрационный материал.
0* (неудовлетворительно)	Доклад не подготовлен либо имеет существенные пробелы по представленной тематике, основан на недостоверной информации, выступающим допущены принципиальные ошибки при изложении материала.

## ПРИМЕРНЫЕ ТЕМЫ ДОКЛАДОВ, СООБЩЕНИЙ ДЛЯ ПРОВЕРКИ УРОВНЯ КОМПЕТЕНЦИИ

### РАЗДЕЛ 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

#### Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками

1. Становление риск-менеджмента.
2. Классификация рисков.
3. Риск-менеджмент как отрасль научного управления.
4. Матрица риска.

#### Тема 1.2. Методология управления рисками

1. Классификация методов управления, обусловленная их содержанием.
2. Сущность уголовно-правовых, административно-правовых, гражданско-правовых методов.
3. Метод компенсации, спекулирования, стимулирования, сдерживания.
4. Охарактеризовать организационные, распорядительные и дисциплинарные методы.
5. Три основные направления в рамках социального управления.

#### Тема 1.3. Процессный подход к управлению рисками

1. 1. Метод постепенного приближения.
2. Дерево целей.
3. Построение рациональной системы организации.
4. Формирование оптимальной структуры организации.
5. Обеспечение организации всеми необходимыми ресурсами (финансовыми, человеческими, материальными, энергетическими и др.).

## **РАЗДЕЛ 2. РИСКООБРАЗУЮЩИЕ СОБЫТИЯ И ИДЕНТИФИКАЦИЯ РИСКОВ**

### **Тема 2.1. Определение рискообразующих событий**

1. Понятие рискообразующих факторов.
2. Основные принципы классификации рискообразующих факторов.
3. Рискообразующие факторы и комплексный подход к исследованию рисков.
4. Интегральные рискообразующие факторы.
5. Методы анализа рисков.

### **Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков**

1. Понятие рискового капитала.
2. Пороговое значение риска.

## **РАЗДЕЛ 3. МОНИТОРИНГ И КОНКРЕТНЫЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ**

### **Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски**

1. Уклонение и сокращение риска.
2. Перераспределение риска.

### **Тема 3.2. Мониторинг управления рисками организации**

1. Текущий, оперативный и стратегический мониторинг.
2. Виды информации. Оперативная информация как средство мониторинга

рисков.

### **Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками**

1. Методы трансформации рисков.
2. Метод отказа от риска.
3. Методы финансирования рисков.

### **2.4. Рекомендации по оцениванию контроля знаний по разделам учебной дисциплины.**

В завершении изучения каждого раздела учебной дисциплины проводится контроль знаний.

Критерии оценивания представлены в таблице:

Оценка (государственная)	Баллы	% правильных ответов
Отлично	5	77-100%
Хорошо	4	65-76%
	3	53-64%
Удовлетворительно	2	41-52%
	1	30-40%
Неудовлетворительно	0*	менее 30

## **ТИПОВЫЕ ТЕСТОВЫЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ КОНТРОЛЯ ЗНАНИЙ ПО РАЗДЕЛАМ ДИСЦИПЛИНЫ**

### **РАЗДЕЛ 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ**

#### **Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками**

#### **Тема 1. 2. Методология управления рисками**

#### **Тема 1. 3. Процессный подход к управлению рисков**

#### **ВЫБЕРИТЕ ОДИН ВЕРНЫЙ ОТВЕТ**

**1. Как трансформируется концепция управления под влиянием нарастания рисков?**

- А) Как принятие ответственности на всех уровнях решений.
- Б) Как изменение решений по распоряжению собственника.
- В) Как коллективное распределение ответственности.
- Г) Как финансовая ответственность за принятие решений.

**2. Смысл статической концепции в управлении рисками заключается в...**

- А) Гибкости в принятии решений.
- Б) Целенаправленности в принятии решений.
- В) Волюнтаризме в принятии решений.
- Г) Неизменности действий после принятия решений.

**3. В каких организациях наиболее работает статическая концепция управления рисками?**

- А) В небольших организациях.
- Б) В финансовых корпорациях
- В) В организациях холдингового типа
- Г) В любых типах организаций.

**4. Конформистская тенденция в управлении рисками означает...**

- А) Приспособление управления к существующей ситуации
- Б) Приспособление управления к прогнозируемой ситуации.
- В) Ориентация управления на бывшие успешные решения.
- Г) Приспособление управления к возможностям менеджмента.

**5. Сущность концепции управления рисками «перформанс» в...**

- А) Предотвращении рисков любой ценой
- Б) Управлении внедрением рисков в экономическую жизнь
- В) Принятии взвешенных и осторожных решений
- Г) Ориентации на поддержку государственных структур.

**6. Что такое методы управления?**

- А) Приемы и способы осуществления функций менеджмента
- Б) Способы решения управленческих задач
- В) Задачи повышения производительности труда.
- Г) Способы повышения квалификации персонала.

**7. Почему классификация методов управления рисками является относительно условной?**

- А) Нет достаточного методологического аппарата
- Б) В реальной жизни сферы применения переплетаются
- В) Не всегда менеджеры могут определить сферы применения
- Г) Все методы работают одинаково во всех сферах.

**8. В чем заключается сущность юридических методов риск-менеджмента?**

- А) В устранении рисков судебным порядком
- Б) В профилактике рисков с помощью законодательства
- В) В нейтрализации рисков с использованием законов
- Г) В сочетании профилактики и нейтрализации.

**9. Административно-правовые методы направлены на ...**

- А) Судебное преследование должников
- Б) Финансовое обеспечение партнеров
- В) Обеспечение неприкосновенности всех ресурсов организации
- Г) Предотвращение неправомерных действий руководства.

**10. Задачей гражданско-правовых методов является**

- А) Возмещение вреда, нанесенного организации противоправными действиями
- Б) Привлечение виновных лиц к ответственности
- В) Регулирование деятельности менеджеров
- Г) Наказание за нарушение производственной дисциплины.

**11. Управление риском – это...**

- А) отказ от рискованного проекта;
- Б) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска;
- В) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска;
- Г) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, уход или

принятие риска.

**12. Ситуацией риска на предприятии называют:**

- А) Альтернативные варианты принятия решений для получения оптимальной величины прибыли;

- Б) Возможность качественно и количественно определить степень вероятности потери прибыли;
- В) Возможность определить вероятность получения дополнительной прибыли.
13. **В явлении «риск» можно выделить следующие основные элементы, взаимосвязь которых составляет его сущность:**
- А) Противоречивость и неопределенность;
- Б) Вероятность получения дополнительной прибыли и неопределенность ее недополучения;
- В) Субъективность и объективность проявления;
- Г) Возможность материальных, нравственных и других потерь, связанных с осуществлением выбранной в условиях неопределенности альтернативы.
14. **Ситуация неопределенности характеризуется тем, что**
- А) Вероятность наступления результатов событий может быть установлена только опытным путем;
- Б) Вероятность наступления события в принципе не устанавливается;
- В) Вероятность наступления события можно определить графическим способом на основе графика нормального распределения случайной величины.
15. **Наиболее важными элементами, положенными в основу классификации рисков, являются:**
- А) Гражданско-правовая форма образования организации;
- Б) Время возникновения и характер последствий;
- В) Объективная и субъективная природа возникновения.
16. **К факторам прямого действия, определяющим уровень риска, относятся:**
- А) Непредвиденные изменения экономической обстановки в стране;
- Б) Малокомпетентная работа управленческих и иных служб;
- В) Непредвиденные действия конкурентов;
- Г) Способ организации труда.
17. **К факторам косвенного действия, определяющим уровень риска, относятся:**
- А) Нестабильность, противоречивость законодательства;
- Б) Недостаток бизнес-информации в фирме;
- В) Ошибки при принятии решений;
- Г) Непредвиденные изменения в отрасли предпринимательской деятельности.
18. **К объективным факторам, определяющим уровень риска, относятся:**
- А) Коррупция и рэкет;
- Б) Ошибки при реализации рискованных ситуаций;
- В) Финансовые проблемы внутри фирмы;
- Г) Непредвиденные изменения экономической обстановки в регионе.
19. **К субъективным факторам, определяющим уровень риска, относятся:**
- А) Разработка, внедрение новых технологий, способ организации труда и т.п.;
- Б) Отсутствие у персонала способности к риску;
- В) Стихийные силы природы и климат;
- Г) Революционные скачки в научно-техническом прогрессе.
20. **Что входит в понятие контроля в риск-менеджменте?**
- А) проверка организации работы по снижению степени риска;
- Б) побуждение финансовых менеджеров и других специалистов к заинтересованности в результате своего труда;
- В) согласованность работы всех звеньев системы управления риском, аппарата управления и специалистов.
21. **Что входит в понятие координация в риск-менеджменте?**
- А) воздействие на объект управления, посредством которого достигается состояние устойчивости этого объекта в случае возникновения отклонения от заданных параметров;
- Б) побуждение финансовых менеджеров и других специалистов к заинтересованности в результате своего труда;
- В) согласованность работы всех звеньев системы управления риском, аппарата управления и специалистов.
22. **Что входит в понятие регулирование в риск-менеджменте?**
- А) проверка организации работы по снижению степени риска;

Б) воздействие на объект управления, посредством которого достигается состояние устойчивости этого объекта в случае возникновения отклонения от заданных параметров;

В) согласованность работы всех звеньев системы управления риском, аппарата управления и специалистов.

23. **Что входит в понятие стимулирование в риск-менеджменте?**

А) побуждение финансовых менеджеров и других специалистов к заинтересованности в результате своего труда;

Б) воздействие на объект управления, посредством которого достигается состояние устойчивости этого объекта в случае возникновения отклонения от заданных параметров;

В) согласованность работы всех звеньев системы управления риском, аппарата управления и специалистов.

24. **Закон неизбежности риска означает, что...**

А) Деятельность любой организации сопровождается рисками;

Б) рискованные ситуации невозможно предусмотреть;

В) с рискованными ситуациями невозможно справиться;

Г) «Кто не рискует, тот не пьет шампанское».

25. **Что определяют принципы управления риском?**

А) Поведение руководителей;

Б) Требования к системе и организации процесса управления;

В) Требования финансовой отчетности;

Г) Основные требования к персоналу организации.

## **РАЗДЕЛ 2. РИСКООБРАЗУЮЩИЕ СОБЫТИЯ И ИДЕНТИФИКАЦИЯ РИСКОВ**

### **Тема 2.1. Определение рискообразующих событий**

### **Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков**

#### **ВЫБЕРИТЕ ОДИН ВЕРНЫЙ ОТВЕТ**

1. **Какие из перечисленных источников могут использоваться для информационного обеспечения риск-менеджмента?**

А) контракты, договоры об имущественных сделках;

Б) кредитные договоры;

В) тенденции развития рынков;

Г) бухгалтерская отчетность и статистическая отчетность.

2. **Суть риск-менеджмента состоит в**

А) устранении риска;

Б) управлении риском;

В) снижении риска;

Г) выборе риска.

3. **Какие факторы принято называть рискообразующими?**

А) сущность процессов или явлений, способствующих возникновению того или иного вида риска и определяющих его характер;

Б) факторы, воздействующие на конкретные риски избирательно.

4. **Назовите основные виды рискообразующих факторов.**

А) субъективные и объективные;

Б) внутренние и внешние;

В) нейтивные и интегральные;

Г) все ответы верны.

5. **Нейтивные рискообразующие факторы – это**

А) факторы, воздействующие только на конкретный вид риска;

Б) факторы, оказывающие влияние на риски сразу нескольких видов.

6. **Интегральные рискообразующие факторы – это**

А) факторы, воздействующие только на конкретный вид риска;

Б) факторы, оказывающие влияние на риски сразу нескольких видов.

7. **Метод моделирования задачи выбора с помощью дерева решений предполагает:**

А) математическое построение вариантов решений;

Б) программное графическое построение вариантов решений;

В) графическое построение вариантов решений.

**8. Методы управления рисками, предполагающие исключение рисков ситуаций из бизнеса, носят название:**

- А) методы диссипации риска;
- Б) методы компенсации риска;
- В) методы уклонения от риска;
- Г) методы локализации риска.

**9. Если событие не может произойти ни при каких условиях, его вероятность равна:**

- А) нулю;
- Б) единице;
- В) 0,5;
- Г) 100%.

**10. Метод моделирования задачи выбора с помощью дерева решений предполагает...**

- А) математическое построение вариантов решений;
- Б) программное графическое построение вариантов решений;
- В) графическое построение вариантов решений.

**11. Что входит в понятие контроля в риск-менеджменте?**

- А) проверка организации работы по снижению степени риска;
- Б) побуждение финансовых менеджеров и других специалистов к заинтересованности в результате своего труда;
- В) согласованность работы всех звеньев системы управления риском, аппарата управления и специалистов.

**12. Методы управления рисками, основанные на четкой идентификации источников риска, носят название...**

- А) методы диссипации риска;
- Б) методы компенсации риска;
- В) методы уклонения от риска;
- Г) методы локализации риска.

**13. Что входит в понятие координация в риск-менеджменте?**

- А) воздействие на объект управления, посредством которого достигается состояние устойчивости этого объекта в случае возникновения отклонения от заданных параметров;
- Б) побуждение финансовых менеджеров и других специалистов к заинтересованности в результате своего труда;
- В) согласованность работы всех звеньев системы управления риском, аппарата управления и специалистов.

**14. Экспертный метод может быть реализован...**

- А) путем обработки мнений опытных предпринимателей и специалистов;
- Б) с помощью опроса респондентов;
- В) путем несистемной выборки.

**15. Что входит в понятие регулирования в риск-менеджменте?**

- А) проверка организации работы по снижению степени риска;
- Б) воздействие на объект управления, посредством которого достигается состояние устойчивости этого объекта в случае возникновения отклонения от заданных параметров;
- В) согласованность работы всех звеньев системы управления риском, аппарата управления и специалистов.

### **РАЗДЕЛ 3. МОНИТОРИНГ И КОНКРЕТНЫЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ**

**Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски**

**Тема 3.2. Мониторинг управления рисками организации**

**Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками**

**ВЫБЕРИТЕ ОДИН ВЕРНЫЙ ОТВЕТ**

**1. Кэптиновая компания – это:**

- А) нестраховая компания;

- Б) другое название финансово-промышленной группы;
- В) это страховая компания, входящая в состав нестраховых организаций;
- Г) компания-спонсор.

**2. Особенностью метода покрытия убытка на основе самострахования является:**

- А) работа с большим числом однородных рисков;
- Б) работа только с неоднородными рисками;
- В) работа с катастрофическими рисками.

**3. Основным недостатком кэптиновых компаний является:**

- А) использование этого инструмента возможно только после возникновения ущерба;
- Б) возможность получения покрытия только незначительного ущерба;
- В) в случае ущерба кэптиновой компании, он распределяется между всеми участниками.

**4. К покрытию убытка на основе страхования прибегают в следующих случаях:**

- А) инвестирование средств страховых фондов в пределах одной деловой единицы;
- Б) сохранение прибыли внутри соответствующей группы;
- В) получение льгот по налогообложению (которые могут быть предусмотрены в ряде стран);
- Г) если существуют большие совокупности рисков, вероятность реализации которых велика, а суммы предполагаемого ущерба небольшие.

**5. При покрытии убытка на основе поддержки государственных либо муниципальных органов к специфическим рискам относят:**

- А) риски, связанные с внешнеэкономической деятельностью;
- Б) риски, связанные с массовым разрушением собственности;
- В) риск изменения цен на товары.

**6. Примером покрытия ущерба за счет передачи ответственности на основе договора является:**

- А) хеджирование;
- Б) кэптиновые страховые организации;
- В) нестраховой пул;
- Г) самострахование.

**7. При использовании метода «Передача риска» покрытие убытка происходит за счет:**

- А) самострахования;
- Б) займа;
- В) резервов;
- Г) страхования.

**8. При использовании метода «Сокращение риска» покрытие убытка происходит за счет:**

- А) нестрахового пула;
- Б) резервов;
- В) спонсора;
- Г) государственной поддержки.

**9. Вторая точка вероятности нежелательного исхода соответствует:**

- А) «нормальному», «разумному» риску, при котором рекомендуется принимать обычные предпринимательские решения;
- Б) вероятности нежелательного исхода;
- В) потерям, равным имущественному состоянию предпринимателя.

**10. Первая точка кривой рисков определяет:**

- А) величину потерь, равных расчетной выручке;
- Б) вероятность нулевых потерь;
- В) вероятности нежелательного исхода.

**11. Критерий гарантированного результата (максимальный критерий Вальда) является критерием:**

- А) наименьшего вреда;
- Б) наибольшего вреда;
- В) оптимистическим;

Г) пессимистическим.

**12. Какие факторы принято называть рискообразующими?**

- А) сущность процессов или явлений, способствующих возникновению того или иного вида риска и определяющих его характер;  
Б) факторы, воздействующие на конкретные риски избирательно.

**13. Разновидностью экспертного метода является:**

- А) метод Дельфи;  
Б) метод Гаусса;  
В) метод Иванова.

**14. При использовании метода «Передача риска» покрытие убытка происходит за счет...**

- А) самострахования;  
Б) займа;  
В) резервов;  
Г) страхования.

**15. Методы управления рисками, предполагающие исключение рискованных ситуаций из бизнеса, носят название:**

- А) методы диссипации риска;  
Б) методы компенсации риска;  
В) методы уклонения от риска;  
Г) методы локализации риска.

**2.5. Критерии оценивания индивидуального задания**

Цель данной работы – осмысление и углубление знаний по данной дисциплине, развитие навыков самостоятельной работы по сбору, систематизации материала, проведению исследования и анализа данных в области управления рисками на макро- и микро- уровнях. Являясь одним из видов научно-исследовательской работы обучающихся, индивидуальное задание способствует формированию у обучающихся аналитического, творческого мышления.

Индивидуальное задание. Оценка инновационного потенциала конкретного предприятия (выбор конкретного предприятия осуществляет обучающийся). Структура работы должна включать введение, основную тематическую часть, выводы и предложения, заключение, библиографический список. Объем 12 – 15 страниц печатного текста.

**Показатели и критерии оценки индивидуального задания**

<b>Максимальное количество баллов</b>	<b>Критерии</b>
6 (отлично)	Выставляется обучающемуся, если он выразил своё мнение по сформулированной проблеме, аргументировал его, точно определив проблему содержание и составляющие. Приведены данные отечественной и зарубежной литературы, статистические сведения, информация нормативно правового характера. Обучающийся знает и владеет навыком самостоятельной исследовательской работы по теме исследования; методами и приемами анализа теоретических и/или практических аспектов изучаемой области. Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет; графически работа оформлена правильно.

5-4 (хорошо)	<p>Выставляется обучающемуся, если работа характеризуется смысловой цельностью, связностью и последовательностью изложения; допущено не более 1 ошибки при объяснении смысла или содержания проблемы. Для аргументации приводятся данные отечественных и зарубежных авторов. Продемонстрированы исследовательские умения и навыки.</p> <p>Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет. Допущены отдельные ошибки в оформлении работы.</p>
3-2 (удовлетворительно)	<p>Выставляется обучающемуся, если в работе обучающийся проводит достаточно самостоятельный анализ основных этапов и смысловых составляющих проблемы; понимает базовые основы и теоретическое обоснование выбранной темы. Привлечены основные источники по рассматриваемой теме. Допущено не более 2 ошибок в содержании проблемы, оформлении работы.</p>
1- (неудовлетворительно)	<p>Выставляется обучающемуся, если работа представляет собой пересказанный или полностью заимствованный исходный текст без каких бы то ни было комментариев, анализа. Не раскрыта структура и теоретическая составляющая темы. Допущено три или более трех ошибок в содержании раскрываемой проблемы, в оформлении работы.</p>

## ВОПРОСЫ К ЗАЧЕТУ С ОЦЕНКОЙ ПО РАЗДЕЛАМ (ТЕМАМ) ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Раздел 1. Теоретико-методологические основы управления рисками

Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками

1. Перечислите основные условия возникновения рисков в деятельности организации.
2. Что понимается под риском в бизнесе?
3. Каким образом инновационная функция риска способствует дальнейшему развитию организации?
4. Выделите характеристики объективного и субъективного понимания риска.
5. Перечислите внешние факторы источников возникновения рисков.
6. Что называют ценой риска?
7. Как можно определить объективные факторы влияния на экономическую деятельность?

Тема 1.2. Методология управления рисками

8. Назовите основные структурные характеристики риска.
9. Чему призваны служить основные методы управления рисками? Перечислите их.
10. Назовите плюсы и минусы методов страхования и резервирования. В каких случаях какой из них более приемлем?
11. Какое место в системе управления рисками занимают методы материального стимулирования?
12. Роль корпоративной культуры в менеджменте очевидна. А как влияет корпоративная культура на готовность к риску в организации?
13. По каким основаниям гражданско – правовые методы управления рисками отличаются от административно – правовых?

Тема 1.3. Процессный подход к управлению рисками

14. В чем состоит сущность процессного подхода к управлению рисками?
15. Дайте определение технологии управления.

16. На какие группы подразделяются функции управления рисками в зависимости от их продолжительности во времени?

17. Что такое системный анализ в управлении рисками?

Раздел 2. Рискообразующие события и идентификация рисков

Тема 2.1. Определение рискообразующих событий

18. Что понимается под идентификацией и анализом рисков?

19. В чем заключается специфика этапа идентификации рисков?

20. Перечислите ряд общих процедур по минимизации последствий риска.

21. Для чего предназначен этап выбора методов управления рисками?

22. В какой области решения по принятию рисков являются первоочередными?

23. Что предполагает этап исполнения выбранного метода управления риском?

24. Как обеспечивает гибкость и адаптивность управления риском этап мониторинга?

Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков

25. Почему приходится сопоставлять реальные расходы с гипотетическими потерями в управлении рисками?

26. Что является целью оценки эффективности проведенных мероприятий?

27. Какова задача этапа осмысления рисков?

28. Дайте общую характеристику концепции приемлемого риска.

29. Как традиции организации и корпоративная культура влияют на определение степени приемлемости риска?

30. Какие методы сбора и анализа информации используются при идентификации риска?

31. Какие этапы можно выделить в процессе идентификации и анализа рисков?

32. Дайте определение программы определения рисками.

33. Какая главная проблема при оценивании рискованного капитала?

Раздел 3. Мониторинг и конкретные методы управления рисками

Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски

34. По каким признакам классифицируются методы управления рисками?

35. В каких случаях следует отказаться от риска?

36. Чему способствует создание программы превентивных мероприятий в рисковом менеджменте?

37. Каким образом дифференциация рисков снижает размер ущерба?

38. Что означает метод аутсорсинга риска?

39. Как частота наступления убытков влияет на применение метода покрытия ущерба из текущего дохода?

40. В чем заключается недостаток создания резервного фонда в организации?

Тема 3.2. Мониторинг управления рисками организации

41. Для организаций какого типа эффективно создание captive страховых компаний? В чем их назначение?

42. Как создается нестраховой пул?

43. Как принципы контроля регулируют контролируемую деятельность в области риск-менеджмента?

44. Что является основными инструментами административного контроля?

45. Каков механизм влияния косвенных факторов на эффективность управления рисками?

46. В чем состоит сущность планирования рисков?

47. Назовите основные виды методов мотивации и их вероятные последствия в системе риск-менеджмента.

Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками

48. Что является основными составляющими мониторинга? 49. Каким образом внешние и внутренние ограничения влияют на риск-менеджмент?

49. Перечислите основные задачи мониторинга управления рисками в малом бизнесе

50. Чем отличается деловая стратегия риск-менеджмента от функциональной?