Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»

ДАЛЬНЕВОСТОЧНЫЙ ИНСТИТУТ УПРАВЛЕНИЯ

УТВЕРЖДЕНО
И.о. директора
М. Ю. Боев

Электронная подпись

ПРОГРАММА МАГИСТРАТУРЫ

Менеджмент организации
(наименование образовательной программы)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ, реализуемой без применения электронного (онлайн) курса

Б1.В.ДВ.05.01 Риск - менеджмент
(код и наименование РПД)

38.04.02 Менеджмент
(код, наименование направления подготовки)

Очная, заочная
(формы обучения)

Год набора –2024

Хабаровск, 2024

Автор-составитель:
кандидат экономических наук, доцент кафедры экономики и цифровых технологий М.В. Ковалева

зав кафедрой
экономики и цифровых технологий кандидат экономических наук, доцент О.Г. Поливаева

РПД Риск - менеджмент одобрена на заседании кафедры экономики и цифровых технологий

Протокол от«05» мая 2024 г. № 9.

СОДЕРЖАНИЕ

Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы 4
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы 4
3. Содержание и структура дисциплины 5
4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся 9
5. Оценочные материалы промежуточной аттестации по дисциплине 17
6. Методические материалы для освоения дисциплины 25
7. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» 32
7.1. Основная литература 32
7.2. Дополнительная литература 32
7.3. Нормативные правовые документы и иная правовая информация 32
7.4. Интернет-ресурсы 33
7.5. Иные источники 33
8. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы 34

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы

1.1. Дисциплина Б1.В.ДВ.05.01 Риск – менеджмент обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код компонента компетенции	Наименование компонента компетенции
ПКр-2	Способен разрабатывать стратегию развития бизнеса, находить и оценивать новые рыночные возможности, формировать и оценивать бизнес-идеи, разрабатывать бизнес-планы создания нового бизнеса и обеспечивать их реализацию	ПКр-2.3	Способен оценивать бизнес-идеи с точки зрения инвестиционной привлекательности
ПКс-2	Способен владеть методами экономического и стратегического анализа поведения экономических агентов и рынков в глобальной среде	ПКс-2.2	Владеет методами стратегического анализа поведения экономических агентов, и рынков в глобальной среде

1.2.В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

ОТФ/ТФ / трудовые или профессиональные действия	Код компонента компетенции	Результаты обучения
Специалист по управлению рисками[1] : А/01.5 Определение ситуации (контекста) и идентификация рисков в деятельности организации; В/01.6 Выработка мероприятий по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и их экономическая оценка С/01.7 Планирование, координирование и нормативное обеспечение интегрированной комплексной деятельности подразделений по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации(частично) Специалист по внутреннему контролю (внутренний контролер)/ Е/01.8 Организация разработки стратегии и определение текущих задач развития системы внутреннего контроля экономического субъекта[2] (частично)	ПКр-2.3 Способен оценивать бизнес-идеи с точки зрения инвестиционной привлекательности	на уровне знаний : - знание основных функциональных стратегий предприятия; видах управленческих решений; отличительных особенностей рисков предприятия на уровне умений : - умение проводить системный анализ рисков, выявлять наиболее приоритетные стратегии, принимать обоснованные управленческие решения на основе анализа стратегий управления рисками фирмы на уровне навыков: - проведение анализа существующей системы стратегического планирования в организации и принятия управленческих решений.
	ПКс-2.2 Владеет методами стратегического анализа поведения экономических агентов, и рынков в глобальной среде	На уровне навыков: - навыки использования методов экономического и стратегического анализа поведения экономических агентов, и рынков в глобальной среде

[1] Профессиональный стандарт Специалист по управлению рисками утвержден Приказом Министерства труда РФ 30.08.2018 № 564н

[2] Приказ Министерства труда и социальной защиты РФ от 22.11.2022 № 731н «Об утверждении профессионального стандарта Специалист по внутреннему контролю (внутренний контролер)

2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО

2.1. Объем дисциплины

На учебную дисциплину отведено 3 ЗЕ по учебному плану направления подготовки 38.04.02 Менеджмент, что составляет 108 ак.ч. / 81 астр.ч., из них:

- для очной формы обучения: 12 ак.ч./ 9 астр.ч. занятий лекционного типа, 28 ак.ч. / 21 астр.ч. занятий семинарского типа; 32 ак.ч./ 24 астр.ч. на самостоятельную работу обучающихся; 36 ак.ч. / 27 астр.ч. – на контроль (самостоятельная работа обучающихся в период зачетно-экзаменационной сессии);

- для заочной формы обучения: 6 ак.ч./ 4,5 астр.ч. занятий лекционного типа, 14 ак.ч. / 10,5 астр.ч. занятий семинарского типа, в т.ч. занятия в интерактивной форме - 2 ак.ч. / 1,5 астр.ч.; 79 ак.ч. / 59,25 астр.ч. самостоятельную работу обучающихся; 9 ак.ч. / 6,75 астр.ч. – на контроль (самостоятельная работа обучающихся в период зачетно-экзаменационной сессии).

2.2. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина Б1.В.ДВ.05.01 Риск – менеджмент изучается обучающимися очной формы обучения на втором курсе, в четвертом семестре; обучающимисяз аочной формы обучения – на третьем курсе в пятом семестре.

Дисциплина закладывает базу для последующего изучения таких дисциплин, как: Б1.В.ДВ.05.01 Управление проектами.

Форма промежуточной аттестации по дисциплине в соответствии с учебным планом: экзамен, курсовой проект, устно в ДОТ.

3. Содержание и структура дисциплины

Очная форма обучения

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины, час.						Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
Тема 1	Объект, цели и задачи дисциплины «Риск-менеджмент»	6	1		2		3	О
Тема 2	Категория риска в науке и практике менеджмента	6	1		2		3	О, Э
Тема 3	Факторы и источники риска в управлении	5	1		1		3	О, Д
Тема 4	Объекты управления рисками	6	2		1		3	О, Р
Тема 5	Классификация рисков	6	1		2		3	О, Д, ПЗ
Тема 6	Роль неопределенности в формировании риска	8	-		5		3	Т, О
Тема 7	Взаимосвязь риска и эффективности управления	5	-		2		3	Д, ИДЗ
Тема 8	Принципы управления рисками	5	-		2		3	О, Д, ПЗ
Тема 9	Методы управления рисками	7	2		2		3	О
Тема 10	Подходы к оценке рисков. Методы анализа рисков	9	2		4*		3	О, Д
Тема 11	Разработка и реализация программы управления рисками	8	2		4*		2	Т, О
	Итого (в период ТО)	72/54	12/9		28/21		32/24	

№ п/п	Наименование тем (разделов),	Объем дисциплины, час.						Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
Промежуточная аттестация		36/27						Экзамен, Курсовой проект
Всего академич. часов		**108**	**12**		**28**		**68**	
Всего астрономич. часов		**81**	**9**		**21**		**51**	

Примечание:
** – формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), тестирование (Т), доклад (Д)*

Заочная форма обучения

№ п/п	Наименование тем и/или разделов	Объем дисциплины, час.						Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
Тема 1	Объект, цели и задачи дисциплины «Риск-менеджмент»	14	-		-		14	О
Тема 2	Категория риска в науке и практике менеджмента	14	-		-		14	О, Э
Тема 3	Факторы и источники риска в управлении	6	-		-		6	О, Д
Тема 4	Объекты управления рисками	7,5	0,5		1		6	О, Р
Тема 5	Классификация рисков	9	1		2		6	О, Д, ПЗ
Тема 6	Роль неопределенности в формировании риска	8,5	0,5		2		6	Т, О
Тема 7	Взаимосвязь риска и эффективности управления	8	1		2		5	Д, ИДЗ
Тема 8	Принципы управления рисками	6	1		1*		4	О, Д, ПЗ
Тема 9	Методы управления рисками	6	-		2		4	О
Тема 10	Подходы к оценке рисков. Методы анализа рисков	11	1		2		8	О, Д
Тема 11	Разработка и реализация программы управления рисками	9	1		2		6	Т, О
	Итого (в период ТО)	99 / 74,25	6/4,5		14/10,5		79/ 59,25	
Промежуточная аттестация		9/6,75						Экзамен, Курсовой проект, устно в ДОТ
Всего академич. часов		**108**	**6**		**14**		**79**	
Всего астроном.часов		**81**	**4,5**		**10,5**		**59,25**	

Примечание:
** – формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), тестирование (Т), доклад (Д)*

Содержание дисциплины

Тема 1. Объект, цели и задачи дисциплины «Риск-менеджмент».

Объект управления рисками как научной дисциплины, цели и задачи. Актуальные направления развития управления рисками. Связь управления рисками с другими областями знания.

Тема 2. Категория риска в науке и практике менеджмента.

Подходы к определению понятия «риск» в экономике и в управлении организацией. Событие риска, последствия риска. Условия риска как объективные условия функционирования и развития организации. Риск, как следствие внешнего воздействия на организацию. Концепция конфликта целей в организации. Роль социально-экономического развития общества в эволюции теории и практики управления рисками.

Тема 3. Факторы и источники риска в управлении.

Взаимосвязь факторов и источников риска. Классификация факторов риска: фоновые, косвенного воздействия, прямого воздействия, внутриорганизационные факторы риска. Взаимосвязь факторов риска. Структурные и процессные факторы риска, их взаимосвязь. Основные проблемы идентификации и оценки влияния процессуальных факторов риска на эффективность управления. Динамика факторов риска как показатель кризисного состояния процессов.

Тема 4. Объекты управления рисками.

Управленческое решение, как объект управления рисками. Управление рисками на индивидуальном уровне. Управление рисками на организационном уровне. Управление рисками на государственном и межгосударственном уровнях.

Тема 5. Классификация рисков.

Принципы и признаки классификации рисков. Морфологическая классификация видов рисков в предпринимательстве. Структурные и процессные риски в управлении. Использование классификации рисков в разработке управленческих решений.

Тема 6. Роль неопределенности в формировании риска.

Объективная природа неопределенности в управлении организацией. Роль неопределенности в развитии организации и формировании риска. Понятие гомеостатического диапазона. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска. Взаимосвязь и закономерности формирования неопределенности и риска при разработке управленческих решений.

Тема 7. Взаимосвязь риска и эффективности управления.

Цели управления рисками. Существенные признаки рисков и их влияние на эффективность управления: частота реализации, масштаб последствий от реализации, однородность рисков. Чистые риски и спекулятивные риски. Управление рисками и регулирование рисков.

Тема 8. Принципы управления рисками.

Аксиомы деятельности по управлению рисками: аксиома всеохватности, аксиома приемлемости, аксиома неповторяемости. Содержание основных видов деятельности по управлению рисками: ретроспективная, текущая, перспективная. Стратегические, тактические и операционные риски, взаимосвязь планирования рисков и планирования развития организации.

Тема 9. Методы управления рисками.

Характеристика методов управления рисками: метод избежания рисков, метод принятия рисков на себя, метод предотвращения убытков, метод уменьшения размера убытков, страхование, самострахование, методы передачи рисков. Принципы использования и комбинирования методов управления рисками.

Тема 10. Подходы к оценке рисков.

Методы анализа рисков. Значение принципов оценки рисков. Методологические принципы оценки рисков: однотипность, позитивность, объективность, корректность, комплексность, взаимозависимость. Количественные и качественные методы оценки

риска, условия их использования и комбинирования. Моделирование в управлении рисками.

Тема 11. Разработка и реализация программы управления рисками.

Общая логика разработки и реализации программы: уточнение стратегии организации по управлению рисками и выбор процедур; предварительный отбор рисков; отбор превентивных мероприятий и формирование их плана; анализ рисков после формирования плана превентивных мероприятий; контроль и пересмотр программы управления рисками; оценка эффективности программы управления рисками.

4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся

4.1. В ходе реализации дисциплины «Риск-менеджмент» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

- при проведении занятий при проведении занятий семинарского типа (аудиторно): опрос (О), тестирование (Т), доклад (Д)
- при проведении занятий семинарского типа (с ДОТ): опрос (О), тестирование (Т), доклад (Д)
- самостоятельной работы студентов (аудиторно, ДОТ): опрос, тестирование.

Тема и/или раздел	Методы текущего контроля успеваемости	Методы текущего контроля Успеваемости в ДОТ
Объект, цели и задачи дисциплины «Риск-менеджмент»	О	О
Категория риска в науке и практике менеджмента	О, Э	О, Э
Факторы и источники риска в управлении	О, Д	О, Д
Объекты управления рисками	О, Р	О, Р
Классификация рисков	О, Д, ПЗ	О, Д, ПЗ
Роль неопределенности в формировании риска	Т, О	Т, О
Взаимосвязь риска и эффективности управления	Д, ИДЗ	Д, ИДЗ
Принципы управления рисками	О, Д, ПЗ	О, Д, ПЗ
Методы управления рисками	О	О
Подходы к оценке рисков. Методы анализа рисков	О, Д	О, Д
Разработка и реализация программы управления рисками	Т, О	Т, О

4.2. Материалы текущего контроля успеваемости

Тема 1. Объект, цели и задачи дисциплины «Риск-менеджмент».
Типовые вопросы для проведения опроса:

1. Объект управления рисками как научной дисциплины, цели и задачи.
2. Актуальные направления развития управления рисками.
3. Связь управления рисками с другими областями знания.
4. Дискуссии о функциях риска
5. Звенья в управлении рисками.
6. Подходы к определению категории «финансовый риск».
7. Признаки классификации финансовых рисков.

Тема 2. Категория риска в науке и практике менеджмента.

Типовые вопросы для проведения опроса:

1 Подходы к определению понятия «риск» в экономике и в управлении организацией.

2 Событие риска, последствия риска.

3 Условия риска как объективные условия функционирования и развития организации. Риск, как следствие внешнего воздействия на организацию. Концепция конфликта целей в организации.

4 Роль социально-экономического развития общества в эволюции теории и практики управления рисками.

Типовые темы эссе

Обучающийся самостоятельно выбирает тему, по которой будет выполнено эссе.

1.Инструменты реализации стратегии управления рисками в организации

2.Инструменты реализации финансовой стратегии по управлению рисками

3.Инструменты реализации инвестиционной политики РФ.

Тема 3. Факторы и источники риска в управлении

Типовые вопросы для проведения опроса:

1. Этапы управления риском.
2. Методы финансирования рисков.
3. Пороговые значения риска.
4. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.
5. Идентификация и анализ рисков.

Типовые темы докладов:

6. Понятие и классификация рисков в страховом бизнесе.
7. Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR).
8. Организация управления риском на производственном предприятии.
9. Метод статистических испытаний (Monte-Carlo simulation).
10. Хеджирование рисков.
11. Управление кредитным риском в деятельности банков.
12. Статистические методы оценки риска.
13. Критерий ожидаемой полезности.
14. Риски в международной банковской деятельности.

Тема 4. Объекты управления рисками

Типовые вопросы для проведения опроса:

1 Управленческое решение, как объект управления рисками. Управление рисками на индивидуальном уровне.

2 Управление рисками на организационном уровне.

3 Управление рисками на государственном и межгосударственном уровнях.

ТЕМАТИКА РЕФЕРАТОВ

1. Практические инструменты риск-анализа.
2. Классификация рисков промышленного предприятия.
3. Программные продукты, используемые для оценки рисков.
4. Измерители интегральной рискованности бизнеса.
5. Применение методов оценки рисков при составлении плана финансирования инвестиционного проекта.
6. Классификация методов снижения последствий рисков.
7. Оценка рисков инвестирования в организацию оценки имущественных комплексов.
8. Формирование стратегии фирмы по управлению рисками и выбор процедур управления ими.
9. Оценка влияния рисков при формировании плана превентивных мероприятий. Критерии оценки и их анализ.
10. Алгоритм оценки мероприятий по снижению рисков.
11. Снижение рисков бизнеса с использованием теории опционов: опционы, фьючерсы, реальные опционы, статическое и динамическое хеджирование опционами.

Обучающийся составляет опорный конспект по теме.

Тема 5. Классификация рисков

Типовые вопросы для проведения опроса:

1 Принятие инвестиционных решений в условиях риска.
2 Управление инвестиционными рисками.
3 Методы измерения инвестиционного дохода и риска.

Типовые темы докладов:

1 Принципы и признаки классификации рисков.
2 Морфологическая классификация видов рисков в предпринимательстве.
3 Структурные и процессные риски в управлении.
4 Использование классификации рисков в разработке управленческих решений.

Типовые задания: Практическая работа студентов

Практическое задание проводится в форме практической подготовки

Индивидуальная работа студента осуществляется в процессе решения рисковых ситуаций, для чего в ходе изучения курса каждому студенту выдается индивидуальное задание для выполнения работ аналитического характера.

Охарактеризовать риски субъектов хозяйствования, составить классификацию финансовых рисков, указать возможные методы снижения последствий рисков по отраслям экономики в Хабаровском крае за трехлетний период и оценить ситуацию. Составить программу управления рисками (с учетом прогноза) до 2026 г., с использованием материалов Госкомстата РФ и Хабаровского края, в частности. Исходные данные приведены в табл.

Таблица

№ варианта	Отрасль
1.	Электроэнергетика
2.	Топливная промышленность
3.	Транспорт
4.	Связь
5.	Машиностроение и металлообработка
6.	Сельское хозяйство
7.	Рыбная промышленность
8.	Пищевая промышленность
9.	Лесная, деревообрабатывающая промышленность
10.	Строительство

Типовые оценочные материалы по теме 5

Типовое задание Примерные тесты для проведения входного контроля

Вариант I. 1. Как понимать содержание категории «риск»?

2.Какие виды рисков Вам известны?

Вариант II. 1. Что Вы понимаете под «управлением риском» ?

2. Какими показателями характеризуется эффективность ПУР?

Вариант III. 1. Что Вы понимаете под «идентификацией рисков»?

2. Какими показателями измеряется масштаб рисков?

Тема 6. Роль неопределенности в формировании риска

Типовые вопросы для проведения опроса:

1 Объективная природа неопределенности в управлении организацией. Роль неопределенности в развитии организации и формировании риска.

2 Понятие гомеостатического диапазона.

3 Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по

степени риска.

4 Взаимосвязь и закономерности формирования неопределенности и риска при разработке управленческих решений.

Типовые тесты по теме:

1. Идентификация риска это:

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

2. Определите, что подразумевается под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков:

а) страховой тариф;

б) страховая сумма;

в) страховая премия.

3. _____ риски могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль.

а) чистые

б) критические

в) спекулятивные

4. Риски по уровню финансовых потерь делятся на:

а) допустимый, критический и катастрофический;

б) недопустимый, допустимый и критический;

в) критический, катастрофический и недопустимый.

5. Вид риска, к которому относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент:

а) экономический

б) предпринимательский

в) политический

6. Подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных спецификой климатических условий, а также наличием природных ресурсов:

а) природно-климатические

б) антропогенные

в) социально-бытовые

7. _____ риски – такие риски, в результате которых реализации предприятию грозит потеря прибыли.

а) катастрофические

б) критические

в) допустимые

8.Укажите, чем измеряется величина или степень риска:

а) средним ожидаемым значение

б) изменчивостью возможного результата

в) оба варианта верны

9. Социально-экономическая функция риска состоит в следующем:

а) 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

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

в) оба варианта верны

10. Выделите метод оценки риска, используемый в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий:

а) имитационное моделирование

б) вероятностный метод

в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости

г) построение дерева решений

д) анализ чувствительности

е) метод сценариев

11. Отметьте метод оценки риска, представляющий собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты:

а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости

б) анализ чувствительности

в) построение дерева решений

г) вероятностный метод

д) метод сценариев

е) имитационное моделирование

12. Субъект управления в риск-менеджменте это:

а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

б) все варианты верны

в) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

13. Объектом управления в риск-менеджменте выступает:

а) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

б) все варианты верны

в) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

14. «Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» — в чем смысл этой фразы?

а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

б) закона неизбежности риска

в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

15. Выберите методы, к которым относится обучение и инструктирование персонала:

а) методы уклонения от рисков

б) методы компенсации рисков

в) методы диверсификации рисков

г) методы локализации рисков

Тема 7. Взаимосвязь риска и эффективности управления

Типовые темы для опроса:

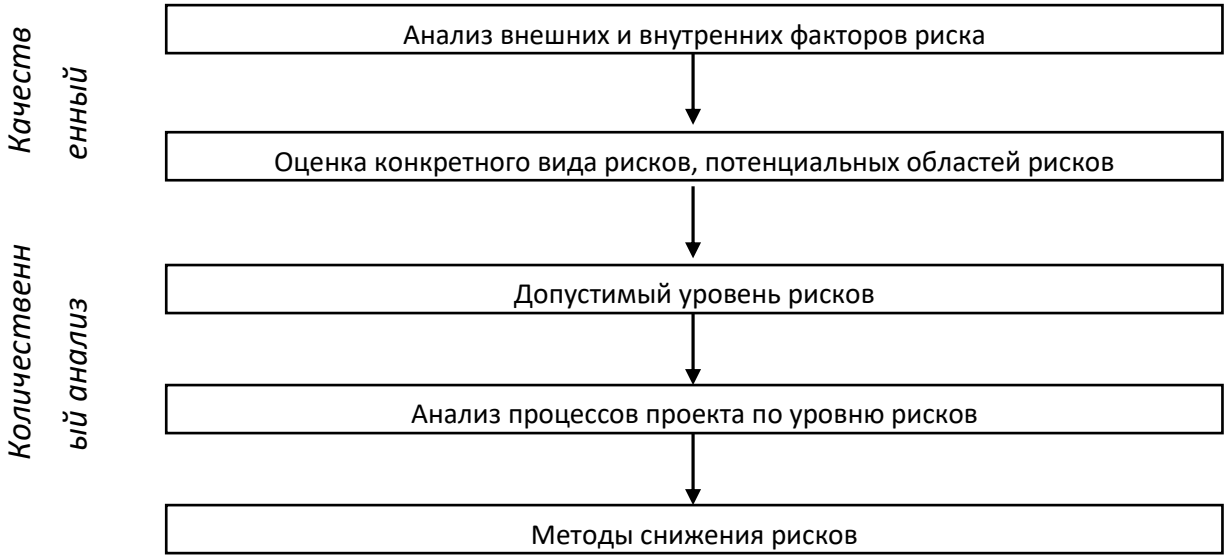
1 Цели управления рисками. Существенные признаки рисков и их влияние на эффективность управления: частота реализации, масштаб последствий от реализации, однородность рисков.

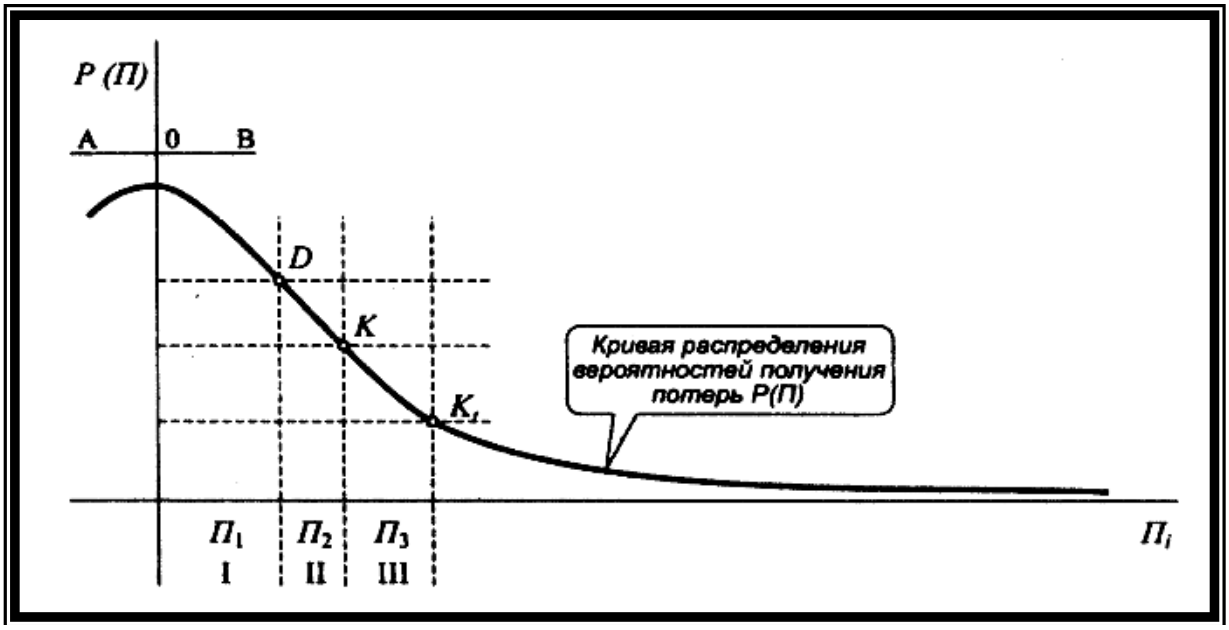
2 Чистые риски и спекулятивные риски.

3 Управление рисками и регулирование рисков.

Типовое задание

Ответить на вопрос : что изображено на рисунке
Алгоритм анализа рисков или классификация рисков





Тема 8. Принципы управления рисками

Типовые вопросы для опроса

1 Принятие решений в условиях риска.
2 Принципы управления инвестиционными рисками.
3 Методы измерения риска.

Типовые темы докладов:

1 Зарубежная практика риск-менеджмента.
2 Основные стратегии вывода предприятия из кризиса.
3 Классификация антикризисных стратегий.
4 Меры по восстановлению платежности должника.
5 Выбор оптимального объема производства в условиях неопределенности спроса.
6 Стратегия и тактика риск-менеджмента.

Типовые задания для проведения «круглого стола»

По теме 8 предполагается проведение круглого стола, на котором происходит обсуждение основных направлений разработки системы риск-менеджмента

Обучающимся необходимо подготовить мини-доклады и презентации к ним по направлениям:

1. Вероятностная модель оценки рисков и управления рисками.
2. Управление рисками инвестиционного проекта.
3. Методы снижения последствий рисков.
4. Принятие решений в условиях риска.
5. Разработка программы управления рисками на предприятии (ПУР).
6. Информационное сопровождение предварительной и основной стадий разработки и пересмотра ПУР.
7. Оценка эффективности ПУР.
8. Формирование плана превентивных мероприятий.

Тема 9. Методы управления рисками.

Типовые вопросы для проведения опроса:

1 Характеристика методов управления рисками: метод избежания рисков, метод принятия рисков на себя, метод предотвращения убытков, метод уменьшения размера убытков, страхование, самострахование, методы передачи рисков.

2 Принципы использования и комбинирования методов управления рисками.

Дополнительные вопросы

1 Вероятностная модель оценки рисков и управления рисками.
2 Идентификация рисков.
3 Имитационное моделирование в количественном анализе рисков.
4 Информационное сопровождение предварительной и основной стадий разработки и пересмотра ПУР.
5 Качественный подход к анализу рисков.
6 Классификация возможных убытков и их оценка.
7 Компьютерный инструментарий оценки проектных рисков.
8 Метод Дельфи.
9 Метод ставки процента (дисконта) с поправкой на риск в инвестиционных расчетах.
10 Методика применения факторного эксперимента к риск-анализу.
11 Методы снижения последствий рисков.
12 Методы экспертных оценок.
13 Модель ценообразования на рынке капитальных вложений САРМ.
14 Оценка эффективности ПУР.
15 Практические инструменты риск-анализа.
16 Принятие решений в условиях риска.
17 Процедуры и методы управления рисками.
18 Разработка программы управления рисками на предприятии (ПУР).
19 Риск как экономическая категория, его сущность.

20 Роза рисков.
21 Система количественных оценок экономического риска: методические подходы.
22 Специфические показатели, используемые для количественной оценки рисков.
23 Спираль рисков.
24 Становление системы риск-менеджмента в России.
25 Схема реализации метода Монте-Карло.
26 Управление рисками инвестиционного проекта.
27 Формирование плана превентивных мероприятий.
28 Характеристика и классификация рисков в предпринимательской деятельности.
29 Экономико-математические модели оценки и управления рисками: модели оптимизации интегральных внешних и внутренних рисковых затрат.

Тема 10. Подходы к оценке рисков
Типовые темы докладов:

1 Методы анализа рисков. Значение принципов оценки рисков.

2 Методологические принципы оценки рисков: однотипность, позитивность, объективность, корректность, комплексность, взаимозависимость.

4. Количественные и качественные методы оценки риска, условия их использования и комбинирования.

5 Моделирование в управлении рисками.

Тема 11. Разработка и реализация программы управления рисками
Типовые вопросы для проведения опроса:

1 Общая логика разработки и реализации программы: уточнение стратегии организации по управлению рисками и выбор процедур; предварительный отбор рисков.

2 Отбор превентивных мероприятий и формирование их плана; анализ рисков после формирования плана превентивных мероприятий; контроль и пересмотр программы управления рисками; оценка эффективности программы управления рисками.

Типовые тесты по теме:

1. Дайте определение термину «риск»:

а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели

б)наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна

в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

2. Что из перечисленного относится кт потерям времени?

а) невыполнение сроков сдачи объекта

б) потери ценных бумаг

в) выплата штрафа

г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

д) уплата дополнительных налогов

3. Процесс использования механизмов уменьшения рисков называется так:

а) диверсификация

б) лимитирование

в) хеджирование

4. Анализ риска подразумевает под собой следующее:

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

5. Выберите, что является принципом действия механизма диверсификации:

а) избежание рисков;

б) разделение рисков;

в) снижение рисков.

6. К этим методам относится распределение ответственности между участниками проекта:

а) методы диверсификации рисков

б) методы компенсации рисков

в) методы локализации рисков

г) методы уклонения от рисков

7. Выберите подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных техногенными катастрофами:

а) антропогенные

б) природно-климатические

в) социально-бытовые

8. Отметьте подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных заболеваемостью животных и людей инфекционными заболеваниями:

а) природно-климатические

б) социально-бытовые

в) антропогенные

9. Укажите группу методов управления экологическими рисками, к которой относится введение нормативных стандартов и ограничений для производителей:

а) распределение прав на загрязнение

б) административное регулирование

в) система платежей и налогов за экологические загрязнения

г) создание экономических стимулов

10. Как называется контракт, который дает право купить определенное количество базового актива по оговоренной цене и в определенный срок?

а) опционом пут

б) фьючерсным контрактом

в) опционом колл

г) форвардным контрактом

11. К каким методам относится прогнозирование внешней обстановки?

а) методы компенсации рисков

б) методы уклонения от рисков

в) методы локализации рисков

г) методы диверсификации рисков

12. К каким методам относится распределение риска по этапам работы?

а) методы локализации рисков

б) методы компенсации рисков

в) методы уклонения от рисков

г) методы диверсификации рисков

13. Выберите, к каким методам относится заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов:

а) методы диверсификации рисков

б) методы уклонения от рисков

в) методы компенсации рисков

г) методы локализации рисков

14. Название риска, который не зависит от состояния рынка и является спецификой конкретной организации:

а) чистый

б) спекулятивный

в) несистемный

г) системный

15. Название риска, связанного с изменениями, вызванными общерыночными колебаниями, и не зависящий от конкретного предприятия:

а) чистый

б) системный

в) несистемный

Устные ответы на вопросы опроса оцениваются по 5-ти балльной шкале по следующим критериям:

5 баллов – студент верно, самостоятельно отвечает на поставленный вопрос, использует различные источники, ссылается на нормативно-правовые акты, выражает собственное мнение.

4 балла – студент верно, самостоятельно отвечает на поставленный вопрос, при ответе использует преимущественно материалы лекционных занятий.

3 балла – студент испытывает затруднения при ответе на поставленный вопрос, не может привести дополнительную информацию, не ссылается на нормативно-правовые акты.

0 баллов – студент не может ответить на поставленный вопрос.

Доклады оцениваются по 5-ти балльной шкале по следующим критериям:

Защита докладов осуществляется в форме групповой дискуссии[3], которая предполагает активное взаимодействие обучающегося с другими обучающимися группы и преподавателем. Дискуссия направлена на развитие коммуникативных навыков и формирования собственной позиции по рассматриваемой проблеме. Помимо содержания доклада преподавателем оценивается процедура его представления группе и аргументированность ответов на задаваемые выступающему вопросы.

5 баллов – доклад написан с соблюдением всех требований к письменным работам обучающихся, тема раскрыта полностью, верно определены объект и предмет исследования, представлен широкий перечень источников (не менее 10), проведен сравнительный анализ, использована действующая нормативно-правовая база, приведены различные точки зрения, сделаны выводы, обучающийся доступно с использованием профессиональной терминологии, без существенной опоры на текст представил основную проблему, которой был посвящен доклад и пути ее решения, обучающийся представил полные и развернутые ответы на вопросы группы, сформировал и отстаивает собственную позицию по рассматриваемой проблеме;

4 балла – доклад написан с соблюдением всех требований к письменным работам обучающихся, тема раскрыта полностью, представлен широкий перечень источников (не менее 10), использована действующая нормативно-правовая база, сравнительный анализ и выводы не представлены, обучающийся доступно, но с существенной опорой на текст, с использованием профессиональной терминологии представил основную проблему, которой был посвящен доклад, обучающийся представил достаточно полные ответы на вопросы группы, сформировал собственную позицию по рассматриваемой проблеме;

3 балла – доклад написан с соблюдением всех требований к письменным работам обучающихся, тема раскрыта не полностью, объект и предмет исследования определены

[3] Защита реферата в форме групповой дискуссии в рамках практического занятия является интерактивной формой проведения занятия

неверно, обучающийся доступно, но с существенной опорой на текст, с частичным использованием профессиональной терминологии представил основную проблему, которой был посвящен доклад, обучающийся представил ответы не на вопросы группы, не сформировал собственную позицию по рассматриваемой проблеме;

0 баллов – тема не раскрыта, неверно определены объект и предмет исследования, список использованных источников недостаточных, отсутствует сравнительный анализ, не сделаны выводы, обучающийся с существенной опорой на текст, без использования профессиональной терминологии представил содержание доклада без формулировки основной проблемы, обучающийся не ответил на вопросы группы, не сформировал какую-либо позицию по рассматриваемой проблеме.

Тесты оцениваются по 5-ти балльной шкале по следующим критериям:

Общая сумма баллов за все правильные ответы составляет наивысший балл 5. В процентном соотношении оценки выставляются в следующих диапазонах:

“2”- менее 50%
“3”- 50%-64%
“4”- 65%-84%
“5”- 85%-100%

5 Оценочные материалы промежуточной аттестации по дисциплине

5.1Экзамен проводится с применением следующих методов (средств):

Экзаменационное задание включает 30 письменных тестовых заданий с закрытыми вопросами.

На выполнение задания обучающемуся отводится 60 минут. Проверка заданий осуществляется преподавателем после сдачи обучающимися бланков ответов, в случае использования ДОТ – после закрытия экзаменационного задания в образовательном портале и формирования ведомости оценок.

Выполнение тестовых экзаменационных заданий оценивается из расчета за каждый правильный ответ – 1 балл. Максимальное количество правильных ответов по билету – 30 (30 тестовых заданий), что равняется 30 баллам.

Обязательным условием итоговой оценки сформированности этапа компетенции также является (помимо промежуточной аттестации) выполнение всех форм текущего контроля. Максимальное количество баллов, которые может набрать обучающийся в рамках изучения дисциплины равно 100 баллов, при этом 70 баллов приходится на текущую аттестацию и 30 баллов - на промежуточную аттестацию (экзамен).

Процедура проведения экзамена установлена в соответствии с Положением по проведению промежуточной аттестации с применением балльно-рейтинговой системы оценки знаний обучающихся в Дальневосточном институте управления – филиале РАНХиГС.

5.2 Оценочные материалы промежуточной аттестации

Компонент компетенции	Ключевой индикатор оценивания	Критерий оценивания
ПКр-2.3 Способен оценивать бизнес-идеи с точки зрения инвестиционной привлекательности	Способность разрабатывать и оценивать бизнес-идеи с точки зрения инвестиционной привлекательности	Самостоятельно разрабатывает и обоснованно оценивает бизнес-идеи организации, идентифицируя и классифицируя риски, вырабатывая мероприятия по воздействию на риск.
ПКс-2.2 Владеет методами стратегического анализа поведения экономических агентов,	Способность применять методы стратегического анализа поведения экономических агентов	Грамотно использует широкий набор методов стратегического анализа поведения экономических агентов при разработке стратегии, определении текущих задач развития системы внутреннего контроля

Компонент компетенции	Ключевой индикатор оценивания	Критерий оценивания
и рынков в глобальной среде		

Типовые тесты для проведения экзамена:

1. Идентификация риска это:

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

2. Определите, что подразумевается под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков:

а) страховой тариф;

б) страховая сумма;

в) страховая премия.

3. _____ риски могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль.

а) чистые

б) критические

в) спекулятивные

4. Риски по уровню финансовых потерь делятся на:

а) допустимый, критический и катастрофический;

б) недопустимый, допустимый и критический;

в) критический, катастрофический и недопустимый.

5. Вид риска, к которому относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент:

а) экономический

б) предпринимательский

в) политический

6. Подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных спецификой климатических условий, а также наличием природных ресурсов:

а) природно-климатические

б) антропогенные

в) социально-бытовые

7. _____ риски – такие риски, в результате которых реализации предприятию грозит потеря прибыли.

а) катастрофические

б) критические

в) допустимые

8.Укажите, чем измеряется величина или степень риска:

а) средним ожидаемым значение

б) изменчивостью возможного результата

в) оба варианта верны

9. Социально-экономическая функция риска состоит в следующем:

а) 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

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

в) оба варианта верны

10. Выделите метод оценки риска, используемый в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий:

а) имитационное моделирование

б) вероятностный метод

в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости

г) построение дерева решений

д) анализ чувствительности

е) метод сценариев

11. Отметьте метод оценки риска, представляющий собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты:

а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости

б) анализ чувствительности

в) построение дерева решений

г) вероятностный метод

д) метод сценариев

е) имитационное моделирование

12. Субъект управления в риск-менеджменте это:

а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

б) все варианты верны

в) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

13. Объектом управления в риск-менеджменте выступает:

а) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

б) все варианты верны

в) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

14. «Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» — в чем смысл этой фразы?

а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

б) закона неизбежности риска

в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

15. Выберите методы, к которым относится обучение и инструктирование персонала:

а) методы уклонения от рисков

б) методы компенсации рисков

в) методы диверсификации рисков

г) методы локализации рисков

16. Дайте определение термину «риск»:

а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели

б)наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна

в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

17. Что из перечисленного относится кт потерям времени?

а) невыполнение сроков сдачи объекта

б) потери ценных бумаг

в) выплата штрафа

г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

д) уплата дополнительных налогов

18. Процесс использования механизмов уменьшения рисков называется так:

а) диверсификация

б) лимитирование

в) хеджирование

19. Анализ риска подразумевает под собой следующее:

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

20. Выберите, что является принципом действия механизма диверсификации:

а) избежание рисков;

б) разделение рисков;

в) снижение рисков.

21. К этим методам относится распределение ответственности между участниками проекта:

а) методы диверсификации рисков

б) методы компенсации рисков

в) методы локализации рисков

г) методы уклонения от рисков

22. Выберите подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных техногенными катастрофами:

а) антропогенные

б) природно-климатические

в) социально-бытовые

23. Отметьте подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных заболеваемостью животных и людей инфекционными заболеваниями:

а) природно-климатические

б) социально-бытовые

в) антропогенные

24. Укажите группу методов управления экологическими рисками, к которой относится введение нормативных стандартов и ограничений для производителей:

а) распределение прав на загрязнение

б) административное регулирование

в) система платежей и налогов за экологические загрязнения

г) создание экономических стимулов

25. Как называется контракт, который дает право купить определенное количество базового актива по оговоренной цене и в определенный срок?

а) опционом пут

б) фьючерсным контрактом

в) опционом колл

г) форвардным контрактом

26. К каким методам относится прогнозирование внешней обстановки?

а) методы компенсации рисков

б) методы уклонения от рисков

в) методы локализации рисков

г) методы диверсификации рисков

27. К каким методам относится распределение риска по этапам работы?

а) методы локализации рисков

б) методы компенсации рисков

в) методы уклонения от рисков

г) методы диверсификации рисков

28. Выберите, к каким методам относится заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов:

а) методы диверсификации рисков

б) методы уклонения от рисков

в) методы компенсации рисков

г) методы локализации рисков

29. Название риска, который не зависит от состояния рынка и является спецификой конкретной организации:

а) чистый

б) спекулятивный

в) несистемный

г) системный

30. Название риска, связанного с изменениями, вызванными общерыночными колебаниями, и не зависящий от конкретного предприятия:

а) чистый

б) системный

в) несистемный

Шкала оценивания

Показатель оценивания	Критерий оценивания	Оценка
на уровне знаний : - знание основных функциональных стратегий предприятия; видах управленческих решений; отличительных особенностей рисков предприятия на уровне умений :	Самостоятельно разрабатывает и обоснованно оценивает бизнес-идеи организации, идентифицируя и классифицируя риски, вырабатывая мероприятия по воздействию на риск. Грамотно использует широкий набор методов стратегического анализа поведения экономических агентов при разработке стратегии, определении текущих задач развития системы внутреннего контроля	отлично
- умение проводить системный анализ рисков, выявлять наиболее приоритетные стратегии, принимать обоснованные управленческие решения на основе анализа стратегий управления рисками фирмы	Разрабатывает и обоснованно оценивает бизнес-идеи организации, идентифицируя и классифицируя риски, вырабатывая мероприятия по воздействию на риск. Грамотно использует основные методы стратегического анализа поведения экономических агентов при разработке стратегии, определении текущих задач развития системы внутреннего контроля	хорошо
на уровне навыков: - проведение анализа существующей системы стратегического планирования в организации и принятия управленческих решений. - навыки использования методов экономического и	Разрабатывает и оценивает бизнес-идеи организации, идентифицируя и классифицируя риски, вырабатывая мероприятия по воздействию на риск. Использует отдельные методы стратегического анализа поведения экономических агентов при разработке стратегии, определении текущих задач развития системы внутреннего контроля .	удовлетворительно

стратегического анализа поведения экономических агентов, и рынков в глобальной среде	Не способен разрабатывать и оценивать бизнес-идеи организации, идентифицируя и классифицируя риски, вырабатывая мероприятия по воздействию на риск использовать методы стратегического анализа поведения экономических агентов при разработке стратегии, определении текущих задач развития системы внутреннего контроля	неудовлетвори тельно

Темы курсового проекта:

Перечень тем курсовой работы

1. Управление и оценка рисков действующего предприятия для целей купли-продажи (на примере …….).
2. Управление и оценка рисков действующего предприятия для его реструктуризации (на примере …….).
3. Управление и оценка рисков действующего предприятия для принятия управленческого решения (на примере …….).
4. Оценка и управление рисками действующего предприятия для целей залога (на примере …….).
5. Оценка и управление рисками действующего предприятия для выпуска дополнительной эмиссии ценных бумаг (на примере …….).
6. Оценка и управление рисками действующего предприятия для разработки плана его развития (на примере …….).
7. Управление рисками действующего предприятия в рамках оценки его инвестиционной привлекательности (на примере …….).
8. Менеджмент и оценка инвестиционных рисков проекта (на примере ….).
9. Оценка и управление рисками транспортного предприятия (на примере ….).
10. Оценка и управление риск-индикаторами промышленного предприятия (на примере….).
11. Оценка и управление рисками строительного предприятия (на примере ….).
12. Управление и оценка рисков торгового предприятия (на примере …….).
13. Управление и оценка рисков ФГУП (на примере …….).
14. Управление и оценка рисков МУП (на примере …….).
15. Управление и оценка рисков предприятия ЖКХ (на примере …….).
16. Управление и оценка рисков рекламного предприятия (на примере …….).
17. Управление и оценка рисков действующего предприятия сферы консалтинга (на примере …….).

18. Управление и оценка рисков образовательного учреждения (на примере ….).
19. Управление и оценка рисков сельскохозяйственного предприятия (на примере …….).
20. Управление и оценка рисков добывающего предприятия (на примере …….).
21. Управление и оценка рисков инновационного предприятия (на примере ….).
22. Управление и оценка рисков учреждения здравоохранения (на примере….).
23. Управление и оценка рисков действующего предприятия сферы услуг (на примере …….).
24. Управление и оценка рисков действующего машиностроительного предприятия (на примере …….).
25. Управление и оценка рисков действующего предприятия связи (на примере….).
26. Управление и оценка рисков действующего предприятия сферы культуры (на примере …….).
27. Управление и оценка рисков страховой компании (на примере …….).
28. Управление и оценка рисков финансово-кредитного института (на примере.).
29. Разработка стратегии риск-менеджмента при определении стоимости контрольного пакета действующего предприятия (на примере ООО, г. Хабаровск)
30. Формирование системы обеспечения безопасности производства в снижении рисков (на примере….).
31. Система планирования в управлении рисками реинжиниринга бизнес-процессов (на примере….).
32. Разработка плана превентивных мероприятий программы управления рисками организации (на примере….).
33. Оценка рисков финансово-кредитного учреждения: анализ зрелости системы риск-менеджмента (на примере……).
34. Риск-менеджмент в оценке эффективности инвестиционных проектов (на примере ….).
35. Разработка риск-индикаторов в принятии инвестиционных решений (на примере….).
36. Анализ рисков как этап разработки программы управления рисками (на примере….).

1. Риск: сущность риска, событие риска, последствия риска.
2. Условия риска как объективные условия деятельности и развития организации. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
3. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.
4. Концепция конфликта целей в организации.
5. Неопределенность, ее роль в развитии организации.
6. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.

7. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска.
8. Существенные признаки рисков. Влияние риска на эффективность управления.
9. Управление рисками и регулирование рисков.
10. Управленческое решение как объект управления рисками.
11. Управление рисками на индивидуальном уровне: основные характеристики объекта управления.
12. Организация как объект управления рисками.
13. Классификация факторов риска по степени непосредственного воздействия на эффективность управления.
14. Структурные и процессуальные факторы риска: проблемы идентификации и оценки.
15. Динамика факторов риска как показатель кризисного развития процессов.
16. Организации как системы: использование типологии организационных систем в управлении рисками.
17. Использование теории жизненного цикла организации при анализе и планировании рисков.
18. Подходы к управлению рисками: интенсивный, экстенсивный.
19. Роль субъекта при разработке решений в условиях риска.
20. Типология субъектов управленческих решений по степени склонности к риску. Субъективная оценка вероятности риска и ожидаемых потерь.
21. Принцип приемлемого риска.
22. Классификации рисков в управлении: признаки классификации, принципы использования.
23. Взаимосвязь структурных и процессных рисков в управлении организацией.
24. Аксиоматика управления рисками.
25. Виды деятельности по управлению рисками.
26. Взаимосвязь планирования в управлении рисками и планирования развития организации.
27. Метод избежания рисков.
28. Метод принятия рисков на себя.
29. Метод предотвращения убытков.
30. Метод уменьшения размера убытков.
31. Метод страхования.
32. Метод самострахования.
33. Метод передачи рисков.
34. Принципы использования и комбинирования методов управления рисками.
35. Методологические принципы оценки рисков.
36. Методические и операционные принципы оценки рисков.
37. Количественные методы оценки рисков.
38. Качественные методы оценки рисков.
39. Использование моделирования в управлении рисками.
40. Определение величины потерь от реализации риска по наличным денежным средствам и ценным бумагам.
41. Определение величины потерь от реализации риска по недвижимому имуществу.
42. Определение величины потерь от реализации риска по машинам, оборудованию и транспортным средствам.
43. Определение величины от реализации риска потерь по запасам.

44. Определение величины потерь от реализации риска по нематериальным активам.
45. Уточнение стратегии организации при разработке программы управления рисками.
46. Предварительный отбор рисков при разработке программы управления рисками.
47. Разработка плана превентивных мероприятий программы управления рисками.
48. Анализ рисков как этап разработки программы управления рисками.
49. Контроль и пересмотр программы управления рисками.
50. Оценка эффективности программы управления рисками.
51. Получение, анализ, хранение и использование информации в целях управления рисками.
52. Использование технических инноваций для повышения эффективности управления рисками.
53. Особенности управления рисками в финансовой и инвестиционной сферах деятельности организации.
54. Риск в управлении прямыми и портфельными инвестициями.
55. Распределение рисков между участниками проекта.
56. Классификация рисков производственной деятельности.
57. Особенности управления рисками взаимодействия с контрагентами в производственной деятельности организации.
58. Роль системы обеспечения безопасности производства в снижении рисков.

Шкала оценивания курсового проекта

Критерии выставляемой оценки	Оценка
Выставляется при выполнении курсового проекта в полном объёме; работа отличается достаточностью проработки всех разделов содержательной части, оформлена с соблюдением установленных правил; студент свободно владеет теоретическим материалом, безошибочно применяет его при решении задач, сформулированных в задании; на все вопросы дает правильные и обоснованные ответы, убедительно защищает свою точку зрения.	Отлично
Выставляется при выполнении курсового проекта в полном объёме; работа отличается достаточностью проработки всех разделов содержательной части, оформлена с соблюдением установленных правил; студент твердо владеет теоретическим материалом, может применять его самостоятельно или по указанию преподавателя; на большинство вопросов даны правильные ответы, защищает свою точку зрения достаточно обосновано.	Хорошо
Выставляется при выполнении курсового проекта в основном правильно, но без достаточно глубокой проработки некоторых разделов; студент усвоил только основные разделы теоретического материала и по указанию преподавателя (без инициативы и самостоятельности) применяет его практически; на вопросы отвечает неуверенно или допускает ошибки, неуверенно защищает свою точку зрения.	Удовлетворительно
Выставляется, когда студент не может защитить свои решения, допускает грубые фактические ошибки при ответах на поставленные вопросы или вовсе не отвечает на них.	Неудовлетворительно

6. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

6.1 Методические указания для обучающихся при работе на занятии лекционного типа.

Занятие лекционного типа представляет собой систематическое, последовательное изложение преподавателем учебного материала в соответствии с изучаемой темой дисциплины.

В ходе лекций преподаватель излагает и разъясняет основные, наиболее сложные понятия темы, а также связанные с ней теоретические и практические проблемы, дает рекомендации на практическое занятие и указания на самостоятельную работу.

В ходе лекций обучающимся рекомендуется обращать внимание на то, что в наши дни происходит формирование новой парадигмы менеджмента, традиционные стили, методы и инструменты управления, сложившиеся в середине прошлого века, заметно меняют свой облик.

Рекомендуется обращать внимание на то, что наряду с появлением новых форм и инструментов управления, сохраняется преемственность теоретических основ и большинства практических методов, разработанных в разные годы в разных странах мира. Поэтому профессиональное овладение практикой менеджмента в наши дни невозможно без глубокого и всестороннего изучения его теоретических основ.

Для удобства восприятия обучаемыми материала, в зависимости от специфики темы преподаватель может избирать индуктивный, дедуктивный, исторический (хронологический) и другие подходы к изложению материала, а также комбинировать их.

6.2 Методические указания для обучающихся при работе на занятии семинарского типа

На занятиях семинарского типа проводится проверка усвоения обучающимися отдельных тем дисциплины, проверка выполнения заданий.

На первом занятии проводится проверка исходного уровня подготовленности обучающегося и его соответствия предъявляемым требованиям для изучения дисциплины.

В ходе подготовки к семинарам обучающемуся рекомендуется изучить основную литературу, ознакомиться с дополнительной литературой, новыми публикациями в периодических изданиях :журналах, газетах и т.д. При этом следует учесть рекомендации преподавателя и требования учебной программы. Рекомендуется также дорабатывать свой конспект лекции, делая в нем соответствующие записи из литературы, рекомендованной преподавателем и предусмотренной учебной программой.

6.3 Методические указания для обучающихся по организации самостоятельной работы.

При самостоятельной работе обучающиеся работают с рекомендованными материалами при минимальном участии преподавателя. Одной из основных форм контроля самостоятельной работы обучаемых является оценка полноты и качества составления конспектов изучаемых материалов.

Конспект – это систематическая, логически связная запись материала, включающая в себя план изучаемого материала, выписки из учебника и дополнительных источников, тезисы материала, собственные мысли, выводы и т.п.

При необходимости обучаемому рекомендуется записывать вопросы, возникшие у него в ходе работы над темой, для обсуждения их с преподавателем в ходе семинаров или консультаций.

6.4 Методические указания для обучающихся по написанию доклада

В процессе изучения дисциплины «Риск-менеджмент» каждым студентом должен быть подготовлен и представлен на обсуждение аудиторией доклад по выбранной теме программы.

Выполнение задания ориентировано на выработку навыков критического анализа теоретических и методических подходов в решении задач финансового менеджмента и их применения на практике, на конкретных примерах, а также презентации и аргументации

предлагаемого решения, умения вести дискуссию и поддерживать конструктивный контакт с аудиторией.

При подготовке доклада предполагается использование не менее 5 источников по выбранной теме, опубликованных в периодической печати в последние 5 лет. Допускается использование статей, обзоров, материалов из сети Интернет, монографий, активная работа с базой институциональной подписки Дальневосточного института управления – филиала РАНХиГС. Предметная часть доклада должна базироваться на анализе финансовых показателей конкретного предприятия (организации).

Доклад должен отразить следующие теоретические положения и практические рекомендации:

1) Анализ актуальности проблемы, выбранной для доклада, с учетом существующих базовых концепций финансового менеджмента, современных методик и состояния практики.

2) Анализ проблемы на примере выбранного конкретного объекта с применением методов и инструментов финансового менеджмента.

3) Обоснованность, содержательность, новизна подходов к решению проблемы, насколько ясно и четко они сформулированы.

4) Преимущества и недостатки предлагаемых подходов.

5)Перспективы применения предлагаемых подходов или распространения практического опыта в других отраслях и организациях.

6) Аргументированную авторскую позицию.

7) Защита доклада осуществляется с представлением презентации в PowerPoint.

6.5 Методические указания для обучающихся по выполнению курсового проекта

Курсовой проект - это письменная работа, как правило, с элементами научного исследования, которые включаются в учебный план образовательной программы высшего образования. Это законченное самостоятельное исследование, частной задачи или проведение исследования в рамках образовательной программы.

Исходными данными для выполнения курсового проекта могут служить результаты научных исследований (монографии, научные сборники, периодические издания и т.д.), нормативно-правовые акты, статистические данные, результаты социологических исследований и др. Курсовой проект может содержать элементы научного исследования и (или) прикладной результат, выражающиеся в анализе и обобщении полученных сведений, в сопоставлении концепций различных авторов, обосновании своей точки зрения.

После выбора темы курсового проекта необходимо подобрать литературу по выбранной теме и ознакомиться с ней. В первую очередь, необходимо изучить источники из представленного в данной разработке библиографического списка, затем подобрать и изучить дополнительную литературу по теме работы. Дополнительными источниками информации могут служить материалы учебников и учебных пособий, монографии, сборники научных трудов, официальные документы органов законодательной и исполнительной власти, данные специализированных журналов, как опубликованные в открытой печати, так и содержащиеся на официальных сайтах в сети Интернет.

При написании курсового проекта следует помнить об архитектуре, то есть соблюдении надлежащих пропорций между разделами и параграфами. Соблюдение этих пропорций делает наглядным логический строй научной работы. Общий объём курсовой работы не должен превышать 30 – 35 страниц печатного текста.

Работу не следует перегружать второстепенной информацией, она также не должна сводиться к переписыванию одного литературного источника или состоять из набора

цитат различных авторов, которые не обобщены и не содержат комментарии студента. Рекомендуется избегать таких выражений, как «я думаю», «по моему мнению», «я считаю». Корректнее излагать материал от третьего лица – «автор предлагает» или от первого лица множественного числа – «по нашему мнению».

При обращении к литературе, другим источникам информации необходимо соблюдать этику цитирования, обязательно оформлять сноски на источники информации. Приводимые мнения различных ученых и практических работников, цифровые материалы, классификации, описание существующего опыта обязательно сопровождаются правильно оформленными ссылками. Ссылка проставляется в квадратных скобках в конце цитаты с указанием порядкового номера источника из библиографического списка.

Курсовой проект значительно выигрывает, если обучающийся иллюстрирует её текст графиками, рисунками, таблицами. На рисунки и таблицы должны быть ссылки по тексту работы. Например: На рисунке 1 показана динамика и т.д.

Методические рекомендации по изучению дисциплины с применением ДОТ

Доступ к системе дистанционных образовательных технологий осуществляется каждым обучающимся самостоятельно с любого устройства на образовательном портале института: https://lms.ranepa.ru. Пароль и логин к личному кабинету / профилю предоставляется студенту в деканате.

Страница каждой дисциплины на образовательном портале имеет следующую структуру и содержание:

1. **Общая информация** содержит:

– РПД – рабочую программу дисциплины, в которой представлены объем и место дисциплины в структуре образовательной программы; содержание и структура дисциплины; материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине; методические указания для обучающихся по освоению дисциплины и т.д);

– Календарно тематический план изучения дисциплины, в котором отражена дата проведения лекционного, семинарского занятий по соответствующей теме и режим проведения занятия (образовательный портал, электронная почта преподавателя, чаты социальных сетей и др.)

– Инструкция по работе в СДО и рекомендации по изучению дисциплины посредством СДО

– График индивидуальных и групповых консультаций

2. **Лекционные материалы –** в этом разделе представлены текстовыми файлами лекции преподавателя (с разбивкой по темам, разделам и т.п.). В дополнение к лекционному материалу могут быть представлены презентации, нормативно-правовые документы

3. **Задания к занятиям семинарского типа (практич. занятиям, семинарам, лаб. работам и т.п.)** – в этом разделе представлены материалы к занятиям семинарского типа отдельными файлами для каждого отдельного занятия (согласно расписанию), в которых в полном объеме отражено содержание занятия по указанной теме, приведены задания с указанием балльной оценки за их выполнение, сроков выполнения и организационных моментов по представлению выполненных заданий преподавателю на проверку (например, сдача заданий старосте группе с последующей их отправкой на почту преподавателя единым письмом или личная отправка задания преподавателю каждым студентом).

4. **Самостоятельная работа –** в этом разделе представлена информация по организации самостоятельной работы студентов, например указаны темы для самостоятельного изучения, перечень индивидуальных заданий, тематика докладов,

рефератов. При наличие обязательной письменной работы (курсовая, проект, реферат, контрольная и т.д.) в этом разделе размещаются методические указания по выполнению этой работы.

5. **Текущий контроль** – в этом разделе представлены задания для выполнения их студентами с целью ведения учета текущей успеваемости студента.

6. **Промежуточная аттестация –** в этом разделе размещается информация по формату промежуточной аттестации, вопросы для подготовки к экзамену (зачету), тесты.

7. **Рекомендуемая литература –** в этом разделе представлен перечень рекомендуемой литературы для изучения дисциплины, ссылки на ЭБС.

8. **Успеваемость –** в этом разделе преподаватель размещает еженедельные сведения по успеваемости студентов.

Таким образом, весь материал необходимый для изучения студентом дисциплины представлен на образовательном портале института.

Для активного взаимодействия диалогового характера (лекции, семинары, консультации) со студентами преподаватель по мере освоения режима обучения с применением ДОТ может использовать различные возможности Интернет-пространства, допустимые для института. Для представления выполненных заданий на проверку преподавателю используется электронная почта преподавателя, образовательный портал института.

Все виды работ проводятся по календарному учебному графику и строго по расписанию. В начале пары преподаватель проверяет присутствующих, дает комментарии по лекции (семинарскому занятию), дает задание, дает рекомендации по его выполнению, комментирует оценку за его выполнение, сроки и процедуру сдачи заданий.

Преподаватель ведет и сохраняет записи текущей успеваемости (выполненные задания, ведомость, студенческий журнал, журнал преподавателя) и видеозаписи и результаты промежуточной аттестации с обязательной идентификацией обучающихся (паспорт).

7. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

7.1. Основная литература

1. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 721 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-17939-2. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: https://urait.ru/bcode/545113 (дата обращения: 28.05.2024).

2. Воронцовский, А. В. Оценка рисков : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02411-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — https://urait.ru/bcode/536576

7.2 Дополнительная литература

1. Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — Москва : ИНФРА-М, 2023. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/6216. - ISBN 978-5-16-013060-6. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1897324Иванов, А. А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие / А. А. Иванов. – М.: Евразийский открытый институт, 2011. – Режим доступа: www.iprbookshop.ru/10817

2. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе [Электронный ресурс]: учебник и практикум для академического бакалавриата / Т. Г. Касьяненко, Г. А.

Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2016. — 381 с. — (Бакалавр и магистр.Академический курс). — ISBN 978-5-9916-6976-4. — Режим доступа: https://www.biblio-online.ru/bcode/390713

3. Рыхтикова, Н. А.Анализ и управление рисками организации : учебное пособие / Н.А. Рыхтикова. — 3-е изд. — Москва : ИНФРА-М, 2021. — 248 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — DOI 10.12737/textbook_597f03f1c44465.44914120. - ISBN 978-5-16-013163-4. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.ru/catalog/product/1937180

4. Фомичев, А. Н.Риск-менеджмент[Электронный ресурс]:учебное пособие / А. Н. Фомичев. — Москва:Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2016 — 372 с. — Режим доступа: http://znanium.com/go.php?id=937403

5. Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций / А. С. Шапкин. – М.: Дашков и К, 2022

7.3.Нормативные правовые документы.

1. КонституцияРоссийскойФедерации//Российскаягазета.1993.http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_28399/ ca928e4d698a928

2. Распоряжение Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг №03-558/р от 25.03.2003г. «Об утверждении квалификационного минимума по специализированному экзамену для специалистов по корпоративным финансам».

3. Постановление ФКЦБФР при Правительстве Российской Федерации от 7 мая 1996 года N 8 "О порядке и объеме информации, которую акционерное общество обязано публиковать в случае публичного размещения им облигаций и иных ценных бумаг" (с изменениями и дополнениями).

4. Федеральный закон от 22 апреля 1996 года N 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг" (с изменениями и дополнениями).

5. Федеральный закон от 5 марта 1999 года N 46-ФЗ "О защите прав и законных интересов инвесторов на рынке ценных бумаг" (с изменениями и дополнениями).

6. Закон РФ от 27.11.92 г. № 4015-1 (ред. от 20.11.99 г.) Об Организации страхового дела в Российской Федерации (с изменениями и дополнениями).

7. УказПрезидентаРФот13.05.2017N208«О Стратегии экономической безопасностиРоссийскойФедерациинапериод до 2030 года» http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_216629/942772dce30cfa36b671bcf19

7.4. Интернет-ресурсы

1. Агентство стратегических инициатив прогнозов [Электронный ресурс]. Режим доступа: https://asi.ru/

2. Ассоциация управления проектами «СОВНЕТ». Режим доступа:: http://www.sovnet.ru.

3. Интернет портал «Управление производством». Режим доступа:http://www.up-pro.ru.

4. Интернет-портал «Управление проектами». Режим доступа:http://forPM.ru

5. Интернет-проект «Корпоративный менеджмент». Режим доступа: http://www.cfin.ru.

6. Информационно-аналитический журнал «Управление проектами». Режим доступа:http://www. https://pmmagazine.ru/.

7. Маркетинг менеджмент — управление, ориентированное на рынок [Электронный ресурс]. Режим доступа: http://m-arket.narod.ru/index.html

8. Международная Ассоциация Управления Проектами (IPMA). Режим доступа:http:// https://www.ipma.world/.

9. Научная электронная библиотека «Киберленинка» [Электронный ресурс]. Режим доступа: https://cyberleninka.ru/

10. Социологическая мастерская [Электронный ресурс]. Режим доступа: http://www.zircon.ru/

11. Центр стратегических оценок и прогнозов [Электронный ресурс]. Режим доступа: http://csef.ru/

12. Официальный сайт государственных органов власти Российской Федерации. – URL.: http:// www.gov.ru.

13. Официальный сайт Президента РФ. – URL.: http:// www.kremlin.ru.

14. Официальный сайт Правительства Российской Федерации.–URL.: http://www.government.ru.

15. Официальный сайт **Федеральной службы по финансовому мониторингу**.– URL.: http://www.fedsfm.ru

16. Российская государственная библиотека. Электронная библиотека диссертаций РГБ. – URL.:http://www.rsl.ru.

17. Универсальная научная электронная библиотека elibrary.ru. – URL.: http://elibrary.ru.

7.5. Иные источники

1. http://e.lanbook.com - электронно-библиотечная система «Лань»
2. http://www.iprbookshop.ru– электронно-библиотечная система «IPRbooks»
3. http://www.biblio-onlain.ru– электронно-библиотечная система ЭБС «Юрайт»
4. ISO 31000: 2009. Международный стандарт «Риск менеджмент – Принципы и руководства»

8. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

Адрес	Наименование оборудованных учебных кабинетов	Оснащенность оборудованных учебных кабинетов, перечень программного обеспечения
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), практик, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Учебные аудитории для самостоятельной работы обучающихся	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.

680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33, Точка кипения	Центр (класс) деловых игр	Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся и преподавателя, технические средства обучения, мультимедийное оборудование, учебно-наглядные пособия, доска маркерная, доступ к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.
680000, Хабаровский край, г. Хабаровск, ул. Муравьева-Амурского, д.33	Специальная библиотека (библиотека ограниченного доступа) /	Помещение для самостоятельной работы обучающихся. Специализированная мебель для организации рабочих мест обучающихся, технические средства обучения, мультимедийное оборудование. Читальный зал научной библиотеки оснащен компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и электронной информационно-образовательной среде. Программное обеспечение: MicrosoftWindows, пакет Microsoftoffice, антивирусное программное обеспечение.