Приложение 7 ОП ВО

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
А.И. Медведев

Электронная подпись

ПРОГРАММА СПЕЦИАЛИТЕТА
Обеспечение экономической безопасности хозяйствующих субъектов

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
реализуемой без применения электронного (онлайн) курса

Б1.В.ДВ.10.02 Корпоративный риск-менеджмент
(код и наименование РПД)

38.05.01 Экономическая безопасность
(код, наименование специальности)

Очная, заочная
(формы обучения)

Год набора – 2023

Хабаровск, 2023 г.

Автор–составитель:

кандидат экономических наук, доцент кафедры менеджмента и предпринимательского права В.Ф. Ефременко

Заведующий кафедрой

менеджмента и предпринимательского права, кандидат социологических наук, доцент Н.П. Сидорова

СОДЕРЖАНИЕ

1.	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы	4
2.	Объем и место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы	4
3.	Содержание и структура дисциплины (модуля)	5
4.	Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)	8
5.	Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)	21
6.	Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)	21
7.	Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы	23

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

1.1. Дисциплина Б1.В.ДВ.10.02 Корпоративный риск-менеджмент обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код компонента компетенции	Наименование компонента компетенции
ПКс-1	Способность формирования стратегии и тактики обеспечения финансовой безопасности на всех уровнях управления	ПКс-1.1	Способность разработки комплекса тактических и стратегических мер по защите финансовых интересов на всех уровнях управления;

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

ОТФ/ТФ *(при наличии профстандарта)*/ трудовые или профессиональные действия	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
формирование трудовых функций, связанных с разработкой методики планирования деятельности службы внутреннего аудита (F/01.7)[1](частично)	ПКс-1.1	- на уровне знаний: факторы риска, взаимосвязь риска и неопределенности; процесс управления рисками; количественные и качественные методы оценки рисков; методы управления рисками - на уровне умений: идентифицировать риски предприятия и причины их возникновения; выбрать методы оценки рисков, соответствующие системе исходной информации; составить и обосновать прогноз динамики развития основных угроз экономической безопасности; выбрать эффективные методы управления рисками - на уровне навыков: формирования системы информации для оценки рисков; выполнения расчетов статистических показателей оценки рисков; выбора оптимального варианта управленческих решений с учетом неопределенности и рисков.

2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО

Объем дисциплины

На учебную дисциплину Б1.В.ДВ.10.02 Корпоративный риск-менеджмент отведено 3 ЗЕ по учебному плану, что составляет 108 акад.ч./81 астр.ч., из них:

- для очной формы обучения на контактную работу выделено 32 акад.ч./24 астр.ч. (из них: 16 акад.ч./12 астр.ч. лекционных занятий и 16 акад.ч./12 астр.ч. практических занятий), 76 акад.ч./57 астр.ч. – на самостоятельную работу.

- для заочной формы обучения на контактную работу выделено 10 акад.ч./7,5

[1]Приказ Минтруда России от 24.06.2015 № 398н «Об утверждении профессионального стандарта «Внутренний аудитор».

астр.ч. (из них: 4 акад.ч./3 астр.ч. лекционных занятий и 6 акад.ч./4,5 астр.ч. практических занятий), 94 акад.ч./70,5 астр.ч. – на самостоятельную работу, 4 акад.ч./3 астр.ч. – на контроль.

Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина Б1.В.ДВ.10.02 Корпоративный риск-менеджмент относится к дисциплинам по выбору вариативной части учебного плана специальности 38.05.01 Экономическая безопасность специализация «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности».

В соответствии с учебным планом дисциплина изучается обучающимися очной формы на 5 курсе в 10 семестре, заочной формы на 6 курсе в 11 семестре.

Форма промежуточной аттестации по дисциплине в соответствии с учебным планом: зачет.

3. Содержание и структура дисциплины

Очная 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	ЛР	ПЗ	КСР		
Тема 1	Объект, цели и задачи дисциплины Корпоративный риск-менеджмент	8	1		1		6	О
Тема 2	Роль неопределенности в формировании риска	9	1		1		7	Д
Тема 3	Факторы и источники риска в корпоративном управлении	11	2		2		7	Д
Тема 4	Объекты управления рисками	9	1		1		7	О
Тема 5	Классификация корпоративных рисков	9	1		1		7	Т
Тема 6	Категория риска в науке и практике менеджмента	11	2		2		7	Д
Тема 7	Взаимосвязь риска и эффективности управления	11	2		2		7	Д
Тема 8	Принципы управления рисками	9	1		1		7	Д
Тема 9	Методы управления рисками	9	1		1		7	О

Тема 10	Подходы к оценке рисков. Методы анализа рисков	11	2		2		7	Д
Тема 11	Разработка и реализация программы управления рисками	11	2		2		7	Т
Промежуточная аттестация								Зачет
Всего:	**Акад.ч.**	**108**	**16**		**16**		**76**	
	Астр.ч.	**81**	**12**		**12**		**57**	

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

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	**ЛР**	**ПЗ**	**КСР**		
Тема 1	Объект, цели и задачи дисциплины Корпоративный риск-менеджмент	4,5	0,5	-	-	-	4	О
Тема 2	Роль неопределенности в формировании риска	10	-	-	1	-	9	Д
Тема 3	Факторы и источники риска в корпоративном управлении	9,5	0,5	-	-	-	9	Д
Тема 4	Объекты управления рисками	10	1	-	-	-	9	О
Тема 5	Классификация корпоративных рисков	10	-	-	1	-	9	Т
Тема 6	Категория риска в науке и практике менеджмента	10	-	-	1	-	9	Д
Тема 7	Взаимосвязь риска и эффективности управления	10	1	-	-	-	9	Д
Тема 8	Принципы управления рисками	10	-	-	1	-	9	Д
Тема 9	Методы управления рисками	10	1	-	-	-	9	О
Тема 10	Подходы к оценке рисков. Методы анализа рисков	10	-	-	1	-	9	Д
Тема 11	Разработка и реализация программы управления рисками	10	-	-	1	-	9	Т
Промежуточная аттестация		**4**						Зачет

Всего:	**Акад.ч.**	**108**	**4**		**6**		**94**	
	Астр.ч.	**81**	**3**		**4,5**		**70,5**	

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

Содержание дисциплины

Тема 1. Объект, цели и задачи дисциплины Корпоративный 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. 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 3. Факторы и источники риска в корпоративном 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. Экономическая автономность, рискозащищенность. Модели экономической рискозащищенности.

Тема 5. Классификация корпоративных 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. 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 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. Методические принципы: диссонансируемость, разновоспринимаемость, динамичность, согласованность. Операционные принципы: моделируемость, симплифицируемость. 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 и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)

4.1. Формы и методы текущего контроля успеваемости обучающихся и промежуточной аттестации.

В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.10.02 Корпоративный риск-менеджмент используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Опрос

Доклад

Тестирование

Промежуточная аттестация проводится в форме:

Зачет.

4.2 Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся

4.2.1. Формой текущего контроля является доклад (с презентацией) по рекомендуемым темам:

1. Эволюция взглядов на категории «риск».
2. Выбор инвестиционного портфеля в условиях неопределенности и риска.
3. Предпосылки и факторы, предшествующие наступлению рисковых ситуаций.
4. Сущность и содержание риск-менеджмента.
5. Анализ и оценка уровня риска.
6. Методы уклонения от риска и его компенсации.
7. Методы управления финансовым риском.
8. Классификация рисков.
9. Роль Банка России в управлении банковскими рисками.
10. Способы снижения процентного и кредитного риска.
11. Понятие и классификация рисков в страховом бизнесе.
12. Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR).
13. Организация управления риском на производственном предприятии.
14. Метод статистических испытаний (Monte-Carlo simulation).
15. Хеджирование рисков.
16. Управление кредитным риском в деятельности банков.
17. Статистические методы оценки риска.
18. Критерий ожидаемой полезности.
19. Риски в международной банковской деятельности.
20. Этапы управления риском.
21. Аутсорсинг управления риском.
22. Методы финансирования рисков.
23. Пороговые значения риска.
24. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.
25. Идентификация и анализ рисков.
26. Меры по предотвращению неплатежеспособности и несостоятельности российских предприятий.
27. Реструктуризация предприятия: подходы и решения.
28. Правовое регулирование отношений в сфере несостоятельности (банкротства).
29. Анализ результатов развития предприятия в условиях быстро меняющейся внешней среды.
30. Пути реструктуризации предприятия с учетом зарубежного опыта.
31. Взгляды экономистов на теорию циклов и кризисов.
32. Методы антирискового регулирования экономики.
33. Причины, факторы и симптомы кризисного развития экономики.
34. Диагностика банкротства предприятий.
35. Зарубежная практика риск-менеджмента.
36. Основные стратегии вывода предприятия из кризиса.
37. Классификация антикризисных стратегий.
38. Меры по восстановлению платежности должника.
39. Выбор оптимального объема производства в условиях неопределенности спроса.

40. Институциональные особенности принятия решений в переходной экономике.
41. Стратегия и тактика риск-менеджмента.

4.2.2. Формой текущего контроля является тестирование согласно приведенного тестового задания

Тестовое задание

1) **Риск – это:**
а) неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток;
б) все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка;
в) вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий;
г) вероятность провала программы продаж;
д) вероятность успеха в бизнесе.

2) **Управление риском – это:**
а) отказ от рискованного проекта;
б) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска;
в) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него;
г) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска.

3) **Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя:**
а) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска;
б) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска;
в) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности;
г) умение ликвидировать такие последствия;
д) разработка и осуществление мер, при помощи которых могут быть нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные результаты предпринимаемых действий.

4) **Содержательная сторона риск-менеджмента включает в себя:**
а) планирование деятельности по реализации рискованного проекта;
б) сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска;
в) выбор мер по минимизации или устранению последствий риска;
г) организация службы управления рисками на предприятии.

5) **Что из перечисленного не является элементом системы риск-менеджмента?**
а) выявление расхождений в альтернативах риска;
б) разработка планов, позволяющих действовать оптимальным образом в ситуации риска;
в) разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий;

г) учет психологического восприятия рискованных проектов;
д) ни один из вариантов не является элементом системы риск-менеджмента;
е) все перечисленное является элементами системы риск-менеджмента.

6) **Какие категории задач риск-менеджмента можно выделить?**
а) применение риск-менеджмента;
б) применение методов риск-менеджмента;
в) управление рисками по их типам;
г) точность оценок рисков;
д) точность прогнозов рисков.

7) **VAR – это**:
а) парадигма стоимости риска (Value-at-Risk);
б) показатель объемов потерь прибыли (Volume at Reduce);
в) степень сопротивления персонала рискованным проектам (Volume at Resistance);
г) объем риска (Volume of Accepted Risk).

8) **Главной функцией риск-менеджмента является:**
а) создание чуткой системы управления рисками;
б) оценка риска по каждому проекту в компании;
в) оценка риска для компании в целом;
г) предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий.

9) **Какие подходы выделяют при расчете VAR?**
а) эмпирический;
б) логический;
в) оценочный;
г) ранжирование;
д) параметрический.

10) **Что из перечисленного не является элементом расчета VAR для одного актива?**
а) текущая стоимость актива;
б) чувствительность стоимости к неблагоприятному изменению фактора риска;
в) изменение стоимости в перспективе;
г) возможное изменение фактора риска при данном доверительном уровне;
д) все вышеперечисленные ответы верны;
е) все вышеперечисленные ответы не верны.

11) **Волатильность – это:**
а) изменчивость рыночного спроса;
б) постоянство рыночного спроса;
в) изменчивость курсовых разниц и процентных ставок;
г) постоянство курсовых разниц и процентных ставок.

12) **Суть риск-менеджмента состоит в:**
а) устранении риска;
б) управлении риском;
в) снижении риска;
г) выборе риска.

13) **Каковы функции объекта управления в риск-менеджменте?**
а) организация разрешения риска;
б) организация рисковых вложений капитала;
в) организация работы по снижению величины риска;
г) организация процесса страхования рисков;
д) организация экономических отношений и связей между субъектами хозяйственного процесса;
е) все перечисленное является функциями объекта управления;
ж) ничего из перечисленного не является функцией объекта управления.

14) **Что из перечисленного не является функциями субъекта управления в риск-менеджменте?**
а) прогнозирование;
б) нормирование;
в) организация;
г) регулирование;
д) координация;
е) распределение;
ж) стимулирование;
з) контроль.

15) **Что из перечисленного является правилами риск-менеджмента?**
а) нельзя рисковать многим ради малого; б) риск – дело благородное;
в) нельзя думать, что существует только одно решение, возможно, есть и другие;
г) при существовании нескольких вариантов, следует идти по пути минимально риска;
д) положительное решение принимается лишь при отсутствии сомнения.

16) **Какие из перечисленных источников могут использоваться для информационного обеспечения риск-менеджмента?**
а) контракты, договоры об имущественных сделках;
б) имидж руководства организации;
в) кредитные договоры;
г) тенденции развития рынков;
д) бухгалтерская отчетность;
е) статистическая отчетность.

17) **Какие риски могут принести дополнительную прибыль фирме?**
а) спекулятивные;
б) чистые;

в) ретроспективные;
г) любые;
д) реализация риска в принципе не может принести дополнительную прибыль компании.

18) **Подразделение рисков на спекулятивные и чистые основано на:**
а) классификации субъектов риска;
б) классификации объектов риска;
в) характере оценки риска;
г) характере последствий риска.

19) **По сфере возникновения выделяют следующие типы рисков:**
а) производственный риск;
б) кадровый риск;
в) информационный риск;
г) финансовый риск;
д) коммерческий риск.

20) **Коммерческий риск – это риск, возникающий:**
а) на коммерческих предприятиях;
б) при заключении коммерческих сделок;
в) в процессе реализации товаров или услуг;
г) в процессе производства товаров или услуг.

21) **Относятся ли риски, связанные с транспортировкой товаров, к группе коммерческих рисков?**
а) да;
б) нет;
в) это зависит от характера транспортировки.

22) **На какие виды подразделяются финансовые риски?**
а) валютные;
б) денежные;
в) инвестиционные;
г) проектные;
д) риски распределения доходности.

23) **Валютный риск связан с:**
а) покупкой и продажей валют;
б) любыми потерями, обусловленными изменением курса иностранной валюты;
в) обменом одной иностранной валюты на другую;
г) ошибками при расчете кросс-курсов.

24) **Инфляционный риск – это**:
а) риск увеличения темпов инфляции;
б) риск опережения роста доходов темпом их обесценивания;

в) риск инфляционных ожиданий;
г) риск возникновения разницы в темпах инфляции на разных рынках сбыта.

25) **Системный риск – это:**
а) риск ухудшения конъюнктуры какого-либо рынка;
б) риск разрушения системы управления организацией;
в) общая система рисков, которым подвергнута организация;
г) система оценки и управления рисками.

26) **Деловой риск – это:**
а) риск неоплаты задолженности дебитором;
б) риск провала коммерческого проекта;
в) риск разрушения деловых отношений;
г) риск неисполнения обязательств по договору купли-продажи.

27) **Инновационный риск – это:**
а) риск срыва сроков сдачи результатов научно-технических исследований;
б) риск того, что новый товар не будет принят рынком;
в) риск того, что инновационный проект не будет реализован или окуплен;
г) риск, связанный с утечкой информации об используемых фирмой инновациях.

28) **Что их перечисленного не относится к видам производственных рисков?**
а) изменение конъюнктуры рынка;
б) усиление конкуренции;
в) форс-мажор;
г) амортизация производственного оборудования.

29) **По времени возникновения неопределенности распределяются на:**
а) ретроспективные, текущие и перспективные;
б) экономические (коммерческие) и политические;
в) новые и старые;
г) изученные, изучаемые и неизученные.

30) **По факторам возникновения неопределенности подразделяются на:**
а) временные;
б) природные;
в) экономические и политические;
г) внешней и внутренней среды.

31) **При наличии неопределенностей процесс выбора оптимальных решений:**
а) усложняется;
б) упрощается;
в) остается неизменным.

32) **Неопределенность, связанную с отсутствием информации о вероятностях состояний среды (природы), называют:**

а) сомнительной;
б) безнадежной;
в) неопределенной;
г) безвозвратной.

33) **Чем рискованнее проект, тем норма его доходности должна быть:**
а) ниже;
б) выше;
в) норма доходности не зависит от риска.

34) **Если событие не может произойти ни при каких условиях, его вероятность равна:**
а) нулю;
б) единице;
в) 0,5;
г) 100%.

35) **Какой метод оценки вероятностей используется в страховании?**
а) система неопределенностей;
б) нормальное распределение;
в) пороговые значения риска.

36) **Методы управления рисками, предполагающие исключение рисковых ситуаций из бизнеса, носят название**:
а) методы диссипации риска;
б) методы компенсации риска;
в) методы уклонения от риска;
г) методы локализации риска.

37) **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.

38) **Методы управления рисками, относящиеся к упреждающим методам управления, носят название:**
а) методы диссипации риска;
б) методы компенсации риска;
в) методы уклонения от риска;
г) методы локализации риска.

39) **Методы управления рисками, связанные с распределением риска между стратегическими партнерами, носят название:**
а) методы диссипации риска;

б) м методы компенсации риска;
в) методы уклонения от риска;
г) методы локализации риска.

40) **Интеграция, предполагающая объединение с поставщиками, – это:**
а) вертикальная регрессивная (обратная) интеграция;
б) вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция;
в) горизонтальная интеграция;
г) круговая интеграция.

41) **Финансирование под уступку денежного требования, подразумевающее передачу кредитного риска, это лежит в основе:**
а) биржевых сделок;
б) строительных контрактов;
в) контракта – поручительства;
г) договора факторинга.
42) **Интеграция, подразумевающая объединение с посредниками, образующими дистрибьюторскую сеть по сбыту продукции предприятия – это:**
а) вертикальная регрессивная (обратная) интеграция;
б) вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция;
в) горизонтальная интеграция;
г) круговая интеграция.

43) **Интеграция, предполагающая объединение с конкурентами, – это:**
а) вертикальная регрессивная (обратная) интеграция;
б) вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция;
в) горизонтальная интеграция;
г) круговая интеграция.

44) **Объединение организаций, осуществляющих разные виды деятельности для достижения совместных стратегических целей, – это:**
а) вертикальная регрессивная (обратная) интеграция;
б) вертикальная прогрессивная (прямая) интеграция;
в) горизонтальная интеграция;
г) круговая интеграция.

45) **Процесс снижение риска за счет увеличения разнообразия видов деятельности, рынков сбыта или каналов поставок носит название:**
а) конвергенция;
б) фокусирование;
в) диверсификация;
г) дифференцирование.

46) **Снижение риска за счет увеличения количества поставщиков, позволяющего ослабить зависимость предприятия от конкретного поставщика, – это:**

а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
б) диверсификация видов хозяйственной деятельности;
в) диверсификация закупок;
г) диверсификация инвестиций.

47) **Снижение риска за счет распределения готовой продукции предприятия между несколькими рынками или контрагентами – это:**
а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
б) диверсификация видов хозяйственной деятельности;
в) диверсификация закупок;
г) диверсификация инвестиций.

48) **Снижение риска за счет расширения ассортимента выпускаемой продукции, оказываемых услуг, спектра используемых технологий – это:**
а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
б) диверсификация видов хозяйственной деятельности;
в) диверсификация закупок;
г) диверсификация инвестиций.

49) **Диссипация риска при формировании инвестиционного портфеля, предполагающего реализацию одновременно нескольких проектов, носит название:**
а) диверсификация рынка сбыта (развитие рынка);
б) диверсификация видов хозяйственной деятельности;
в) диверсификация закупок;
г) диверсификация инвестиций.

50) **Прогнозирование внешней экономической обстановки, стратегическое планирование, мониторинг социально-экономической и нормативно-правовой среды, создание системы резервов – все это инструментарий:**
а) методов диссипации риска;
б) методов компенсации риска;
в) методов уклонения от риска;
г) методов локализации риска.

4.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации. Промежуточная аттестация проводится в форме зачета.

Вопросы к зачету:

1. Риск: сущность риска, событие риска, последствия риска.
2. Условия риска как объективные условия деятельности и развития организации.
3. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
4. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.

5. Концепция конфликта целей в организации.
6. Неопределенность, ее роль в развитии организации.
7. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.
8. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска.
9. Существенные признаки рисков. Влияние риска на эффективность управления.
10. Управление рисками и регулирование рисков.
11. Управленческое решение как объект управления рисками.
12. Управление рисками на индивидуальном уровне: основные характеристики объекта управления.
13. Организация как объект управления рисками.
14. Экономическая автономность, рискозащищенность. Модели экономической рискозащищенности.
15. Классификация факторов риска по степени непосредственного воздействия на эффективность управления.
16. Структурные и процессуальные факторы риска: проблемы идентификации и оценки.
17. Динамика факторов риска как показатель кризисного развития процессов.
18. Организации как системы: использование типологии организационных систем в управлении рисками.
19. Использование теории жизненного цикла организации при анализе и планировании рисков.
20. Подходы к управлению рисками: интенсивный, экстенсивный.
21. Роль субъекта при разработке решений в условиях риска.
22. Типология субъектов управленческих решений по степени склонности к риску. Субъективная оценка вероятности риска и ожидаемых потерь.
23. Принцип приемлемого риска.
24. Классификации рисков в управлении: признаки классификации, принципы использования.
25. Взаимосвязь структурных и процессных рисков в управлении организацией.
26. Аксиоматика управления рисками.
27. Виды деятельности по управлению рисками.
28. Взаимосвязь планирования в управлении рисками и планирования развития организации.
29. Метод избежания рисков.
30. Метод принятия рисков на себя.
31. Метод предотвращения убытков.
32. Метод уменьшения размера убытков.
33. Метод страхования.
34. Метод самострахования.
35. Метод передачи рисков.
36. Принципы использования и комбинирования методов управления рисками.
37. Методологические принципы оценки рисков.

38. Методические и операционные принципы оценки рисков.
39. Количественные методы оценки рисков.
40. Качественные методы оценки рисков.
41. Использование моделирования в управлении рисками.
42. Определение величины потерь от реализации риска по наличным денежным средствам и ценным бумагам.
43. Определение величины потерь от реализации риска по недвижимому имуществу.
44. Определение величины потерь от реализации риска по машинам, оборудованию и транспортным средствам.
45. Определение величины от реализации риска потерь по запасам.
46. Определение величины потерь от реализации риска по нематериальным активам.
47. Уточнение стратегии организации при разработке программы управления рисками.
48. Предварительный отбор рисков при разработке программы управления рисками.
49. Разработка плана превентивных мероприятий программы управления рисками.
50. Анализ рисков как этап разработки программы управления рисками.
51. Контроль и пересмотр программы управления рисками.
52. Оценка эффективности программы управления рисками.
53. Получение, анализ, хранение и использование информации в целях управления рисками.
54. Использование технических инноваций для повышения эффективности управления рисками.
55. Особенности управления рисками в финансовой и инвестиционной сферах деятельности организации.
56. Риск в управлении прямыми и портфельными инвестициями.
57. Распределение рисков между участниками проекта.
58. Классификация рисков производственной деятельности.
59. Особенности управления рисками взаимодействия с контрагентами в производственной деятельности организации.
60. Роль системы обеспечения безопасности производства в снижении рисков.

4.3.1.Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПКс-1	Способность формирования стратегии и тактики обеспечения финансовой безопасности на всех уровнях управления	ПКс-1.1	Формирование способности использовать методы и инструменты составления прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности хозяйствующего субъекта на

			основе оценки корпоративных рисков.

4.3.2. Показатели и критерии оценивания на различных этапах их формирования

Этап освоения компетенции	Показатель оценивания	Критерий оценивания	Средства (методы) оценивания
ПКс-1.3 Формирование способности использовать методы и инструменты составления прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности хозяйствующего субъекта на основе оценки корпоративных рисков	Сформирована способность использовать методы и инструменты составления прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности хозяйствующего субъекта на основе оценки корпоративных рисков	Продемонстрирована способность использовать методы и инструменты составления прогнозов динамики развития основных угроз экономической безопасности хозяйствующего субъекта на основе оценки корпоративных рисков	Зачет по результатам собеседования по вопросам

4.4. Шкала оценивания.

Все виды участия студента в аудиторных практических (семинарских) занятиях и оцениваются по 100-балльной шкале: 70 баллов текущий контроль + 30 баллов аттестация (зачет). Общая максимальная сумма баллов, которую студент может набрать в течение семестра за выполнение семестровых контрольных мероприятий, активность и посещаемость составляет 70 баллов. Минимальная сумма баллов, при которой студент допускается к аттестации (экзамену) составляет 40 баллов. Итоговая оценка формируется в процессе освоения тем учебной программы дисциплины.

Балльно-рейтинговая система оценки

№	Вид контроля	Максимальное количество баллов
1	Доклад с презентацией	40
2	Тест	20
3	Опрос	10 баллов за 2 правильных ответа
4	Зачет	30
Итого:		100

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

В процессе изучения дисциплины 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. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", включая перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

6.1. Основная литература.

1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : Учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : Издательство Юрайт, 2019. - 365 с. - (Авторский учебник). - Режим доступа: https://www.biblio-online.ru. - ISBN 978-5-9916-3502-8 : 859.00. URL: https://www.biblio-online.ru/book/risk-menedzhment-432176.
2. Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учеб.пособие / А. Н. Фомичев ; А.Н. Фомичев. – Москва : Дашков и К, 2016. – 292 с. – Режим доступа: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=77294

6.2. Дополнительная литература.

3. Иванов, А. А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : Учебное пособие / А. А. Иванов, С. Я. Олейников, С. А. Бочаров ; Иванов А. А. – Москва :

Евразийский открытый институт, 2011. – 304 c. – Книга находится в базовой версии ЭБС IPRbooks. – Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/10817.

4. Балдин К.В. Управление рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012.— 512 c.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/10513.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
5. Плотникова М.С. Управление рисками [Электронный ресурс]. М.: Лаборатория книги, 2010. Режим доступа: http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=89594
6. Риск-менеджмент инвестиционного проекта : учебник для вузов / под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина. – М. : ЮНИТИ, 2009. – 544 с. : ил.
7. Титаренко Б.П. Управление рисками в инновационных проектах [Электронный ресурс]: монография/ Титаренко Б.П.— Электрон. текстовые данные.— М.: Московский государственный строительный университет, ЭБС АСВ, 2011.— 144 c.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/16322.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
8. Тихонов Е.П. Риски в управлении предприятием: виды, анализ, оценка, пути и методы снижения. [Электронный ресурс]. М.: Лаборатория книги, 2011. Режим доступа: http://www.biblioclub.ru/index.php?page=book&id=142357

6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы.

9. Воробьев С.Н. и др. Управление рисками [Электронный ресурс]. М.: Юнити-Дана, 2012. Режим доступа: http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=1175453

6.4. Нормативные правовые документы

10. Инструкция №1. «О порядке деятельности кредитных организаций», в ред. Письма ЦБ РФ от 31.01.97 №402. (с изменениями и дополнениями).
11. 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).
12. Федеральный закон от 22 апреля 1996 года N 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг" (с изменениями и дополнениями).
13. 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).
14. ГОСТ Р ИСО 31000-2010. Менеджмент риска. Принципы и руководство.
15. ГОСТ Р ИСО / МЭК 31010-2011. Менеджмент риска. Методы оценки риска.

6.5. Интернет-ресурсы.

16. Научная библиотека РАНХиГС [Электронный ресурс] / Официальный сайт – Режим доступа:http://lib.ranepa.ru/
17. Электронно-библиотечная система IPRbooks[Электронный ресурс] / Официальный сайт – Режим доступа:http://www.iprbookshop.ru/

18. Электронно-библиотечная система Издательство «Лань» [Электронный ресурс] / Официальный сайт – Режим доступа:http://e.lanbook.com/
19. Агентство СПАРК. - Режим доступа: http://www.spark-interfax.ru/#_top.
20. Агентство Expert РА. - Режим доступа: https://raexpert.ru/.

7 Материально-техническое и программное обеспечение дисциплины

Наименование специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы	Перечень лицензионного программного обеспечения и информационных справочных систем
315-0 учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, научно-исследовательской работы; помещение для самостоятельной работы	письменные столы, стулья, рабочее место преподавателя, доска с маркером, комплект переносного оборудования (ноутбук, проектор, экран), доступ к сети «Интернет», локальная аудиторная сеть, учебно-наглядные пособия	Microsoft Office 2013 Standart (договор № 64770024 от 12.02.15 с ООО «Пионер»), Windows 8.1 (договор № 59/21 от 25.10.21 с ООО «+Альянс»)
311 учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, научно-исследовательской работы; помещение для самостоятельной работы	письменные столы, стулья, рабочее место преподавателя, доска с маркером, комплект переносного оборудования (ноутбук, проектор, экран), доступ к сети «Интернет», локальная аудиторная сеть, учебно-наглядные пособия	Microsoft Office 2013 Standart (договор № 64770024 от 12.02.15 с ООО «Пионер»), Windows 8.1 (договор № 59/21 от 25.10.21 с ООО «+Альянс»)
308-0 учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, научно-исследовательской работы; помещение для самостоятельной работы	письменные столы, стулья, рабочее место преподавателя, доска с маркером, комплект переносного оборудования (ноутбук, проектор, экран), доступ к сети «Интернет», локальная аудиторная сеть, учебно-наглядные пособия	Microsoft Office 2013 Standart (договор № 64770024 от 12.02.15 с ООО «Пионер»), Windows 8.1 (договор № 59/21 от 25.10.21 с ООО «+Альянс»)
206-0 учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, научно-исследовательской работы; помещение для самостоятельной работы	письменные столы, стулья, рабочее место преподавателя, доска с маркером, комплект переносного оборудования (ноутбук, проектор, экран), доступ к сети «Интернет», локальная аудиторная сеть, учебно-наглядные пособия	Microsoft Office 2013 Standart (договор № 64770024 от 12.02.15 с ООО «Пионер»), Windows 8.1 (договор № 59/21 от 25.10.21 с ООО «+Альянс»)
210-0учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, научно-исследовательской работы; помещение для самостоятельной работы	письменные столы, стулья, рабочее место преподавателя, доска с маркером, комплект переносного оборудования (ноутбук, проектор, экран), доступ к сети «Интернет», локальная аудиторная сеть, учебно-наглядные пособия	Microsoft Office 2013 Standart (договор № 64770024 от 12.02.15 с ООО «Пионер»), Windows 8.1 (договор № 59/21 от 25.10.21 с ООО «+Альянс»)
105 учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, научно-исследовательской работы; помещение для самостоятельной работы	письменные столы, стулья, рабочее место преподавателя, доска с маркером, проектор, ноутбук(переносной), экран, доступ к сети «Интернет», локальная аудиторная сеть, учебно-наглядные пособия	Microsoft Office 2013 Standart (договор № 64770024 от 12.02.15 с ООО «Пионер»), Windows 8.1 (договор № 59/21 от 25.10.21 с ООО «+Альянс»)
318-0 учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского	письменные столы, стулья, рабочее место преподавателя,	Microsoft Office 2013 Standart (договор № 64770024 от

типа, групповых и индивидуальных консультаций, для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации, научно-исследовательской работы; помещение для самостоятельной работы	доска с маркером, проектор, ноутбук (переносной), экран, доступ к сети «Интернет», локальная аудиторная сеть, учебно-наглядные пособия	12.02.15 с ООО «Пионер»), Windows 8.1 (договор № 59/21 от 25.10.21 с ООО «+Альянс»)

Информационные технологии реализуются через электронно-информационную образовательную среду академии.