

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: Врио ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 29.06.2023 13:12:21

Уникальный программный ключ:

b2fd765521f4c570b8c6e8e502a10b4f1de8ae0d

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

Институт Институт экономики предприятий

Кафедра Учета, анализа и экономической безопасности

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 11 от 30 мая 2023 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.В.ДЭ.04.01 Анализ и управление рисками

Основная профессиональная образовательная программа 38.04.01 Экономика программа Финансовый контроль, консалтинг и анализ бизнеса

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2023

Содержание (рабочая программа)

Стр.

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

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

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Анализ и управление рисками входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений (дисциплина по выбору) блока Б1. Дисциплины (модули)

Последующие дисциплины по связям компетенций: Стратегический анализ коммерческих организаций, Финансовый анализ (продвинутый уровень), Контроль и ревизия, Аудит

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

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

Универсальные компетенции (УК):

УК-6 - Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
УК-6	УК-6.1: Знать:	УК-6.2: Уметь:	УК-6.3: Владеть (иметь навыки):
	основные принципы профессионального и личностного развития, исходя из этапов карьерного роста и требований рынка труда; способы совершенствования своей деятельности на основе самооценки	решать задачи собственного профессионального и личностного развития, включая задачи изменения карьерной траектории; расставлять приоритеты	способами управления своей познавательной деятельностью и ее совершенствования на основе самооценки и принципов образования в течение всей жизни

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-1 - Способен обосновывать решения на основе разработанных для них целевых показателей

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-1	ПК-1.1: Знать:	ПК-1.2: Уметь:	ПК-1.3: Владеть (иметь навыки):
	основные целевые индикаторы/показатели используемые для обоснования решений в профессиональной области	формировать систему целевых показателей, характеризующих конкретную финансово-экономическую область и риски их недостижения	навыками прогнозирования целевых показателей, характеризующих конкретную финансово-экономическую деятельность организации и оценки риска их недостижения

ПК-2 - Способен руководить проведением анализа для обоснования управленческого решения

Планируемые результаты	Планируемые результаты обучения по дисциплине

обучения по программе			
ПК-2	ПК-2.1: Знать:	ПК-2.2: Уметь:	ПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	основные правила составления отчетов и рекомендаций по результатам проведения конкретного направления анализа и этапы его проведения	проводить анализ полученных результатов обоснования управленческого решения	методами и инструментами оценки проведенного анализа для обоснования управленческого решения в конкретной профессиональной деятельности

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 2
Контактная работа, в том числе:	8.15/0.23
Занятия лекционного типа	4/0.11
Занятия семинарского типа	4/0.11
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Самостоятельная работа:	117.85/3.27
Промежуточная аттестация	18/0.5
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	144
Зачетные единицы	4

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Анализ и управление рисками представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий

Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практич. занятия				
1.	Теоретические основы анализа и управления рисками	2	2			50	УК-6.1, УК-6.2, УК-6.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
2.	Методика анализа и управления рисками	2	2			67,85	УК-6.1, УК-6.2, УК-6.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
	Контроль	18					
	Итого	4	4	0.15		117.85	5

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Теоретические основы анализа и управления рисками	лекция	Сущность термина «риск». Классификация рисков. Походы в управлении рисками
2.	Методика анализа и управления рисками	лекция	Методы оценки рисков: количественные и качественные. Матрица рисков. Методы работы с рисками

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

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Теоретические основы анализа и управления рисками	практическое занятие	Сущность термина «риск». Классификация рисков. Походы в управлении рисками
2.	Методика анализа и управления рисками	практическое занятие	Методы оценки рисков: количественные и качественные. Матрица рисков. Методы работы с рисками

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

Иная контактная работа

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

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

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Теоретические основы анализа и управления рисками	- подготовка доклада - тестирование
2.	Методика анализа и управления рисками	- подготовка доклада - тестирование

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

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

1. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 485 с. — (Высшее

образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/511534>

2. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 569 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13380-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/511958>

Дополнительная литература

1. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510969>

Литература для самостоятельного изучения

1. Финансовый анализ : учебник и практикум для вузов / И. Ю. Евстафьева [и др.] ; под общей редакцией И. Ю. Евстафьевой, В. А. Черненко. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 337 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00627-8. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468910>

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

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

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)

2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)

3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

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

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

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска

	Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

5.6. Лаборатории и лабораторное оборудование

Лаборатории и лабораторное оборудование для изучения дисциплины «Анализ и управление рисками» не требуются.

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

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

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

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

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

Универсальные компетенции (УК):

УК-6 - Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки

Планируемые результаты	Планируемые результаты обучения по дисциплине
------------------------	---

обучения по программе			
	УК-6.1: Знать:	УК-6.2: Уметь:	УК-6.3: Владеть (иметь навыки):
	основные принципы профессионального и личностного развития, исходя из этапов карьерного роста и требований рынка труда; способы совершенствования своей деятельности на основе самооценки	решать задачи собственного профессионального и личностного развития, включая задачи изменения карьерной траектории; расставлять приоритеты	способами управления своей познавательной деятельностью и ее совершенствования на основе самооценки и принципов образования в течение всей жизни
Пороговый	-методологические основы и функции управления, принципы разработки организационно-управленческих решений, виды ответственности за принятые организационно-управленческие решения	-творчески решать профессиональные задачи, проявлять инициативу, в том числе в ситуациях риска, принимать ответственность за свои решения в рамках профессиональной компетенции	-навыками постановки стратегических целей и решения практических задач, связанных с принятием оптимальных организационно-управленческих решений
Стандартный (в дополнение к пороговому)	-методологические основы и функции управления, принципы разработки организационно-управленческих решений, виды ответственности за принятые организационно-управленческие решения; -технологии, способы и методы реализации оптимальных организационно-управленческих решений	-творчески решать профессиональные задачи, проявлять инициативу, в том числе в ситуациях риска, принимать ответственность за свои решения в рамках профессиональной компетенции; -аргументировать принятие оптимальных организационно-управленческих решения в профессиональной деятельности	-навыками постановки стратегических целей и решения практических задач, связанных с принятием оптимальных организационно-управленческих решений; -методами и приемами принятия организационно-управленческих решений
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	-методологические основы и функции управления, принципы разработки организационно-управленческих решений, виды ответственности за принятые организационно-управленческие решения; -технологии, способы и методы реализации оптимальных организационно-управленческих решений;	-творчески решать профессиональные задачи, проявлять инициативу, в том числе в ситуациях риска, принимать ответственность за свои решения в рамках профессиональной компетенции; -аргументировать принятие оптимальных организационно-управленческих решения	-навыками постановки стратегических целей и решения практических задач, связанных с принятием оптимальных организационно-управленческих решений; -методами и приемами принятия организационно-управленческих решений; -методами анализа рисков в реальном секторе экономики.

	-основы теории риска	в профессиональной деятельности; -формировать необходимую исходную информацию для оценки риска и обоснования управления рисками	
--	----------------------	--	--

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-1 - Способен обосновывать решения на основе разработанных для них целевых показателей

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-1.1: Знать:	ПК-1.2: Уметь:	ПК-1.3: Владеть (иметь навыки):
	основные целевые индикаторы/показатели используемые для обоснования решений в профессиональной области	формировать систему целевых показателей, характеризующих конкретную финансово-экономическую область и риски их недостижения	навыками прогнозирования целевых показателей, характеризующих конкретную финансово-экономическую деятельность организации и оценки риска их недостижения
Пороговый	основные целевые индикаторы/показатели используемые для обоснования решений в профессиональной области	формировать систему целевых показателей, характеризующих конкретную финансово-экономическую область и риски их недостижения	навыками прогнозирования целевых показателей, характеризующих конкретную финансово-экономическую деятельность организации и оценки риска их недостижения
Стандартный (в дополнение к пороговому)	-требования к уровням и динамике показателей экономических разделов плана, обеспечивающие экономическую безопасность хозяйствующих субъектов	-обосновывать состав показателей экономических разделов плана, рассчитывать и интерпретировать результаты расчетов в соответствии с требованиями эффективного развития хозяйствующих субъектов	-навыками разработки экономических разделов планов в соответствии с требованиями экономической безопасности
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	-требования к уровням и динамике показателей экономических разделов плана, обеспечивающие экономическую безопасность хозяйствующих субъектов; -характеристики угроз, возникающих при	-обосновывать состав показателей экономических разделов плана, рассчитывать и интерпретировать результаты расчетов в соответствии с требованиями эффективного развития хозяйствующих субъектов;	-навыками разработки экономических разделов планов в соответствии с требованиями экономической безопасности; -навыками прогнозирования рисков и угроз, возникающих при планировании и осуществлении инновационных проектов

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

ПК-2 - Способен руководить проведением анализа для обоснования управленческого решения

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-2.1: Знать:	ПК-2.2: Уметь:	ПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	основные правила составления отчетов и рекомендаций по результатам проведения конкретного направления анализа и этапы его проведения	проводить анализ полученных результатов обоснования управленческого решения	методами и инструментами оценки проведенного анализа для обоснования управленческого решения в конкретной профессиональной деятельности
Пороговый	-прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов	-прогнозировать динамику основных экономических показателей	-навыками прогнозирования экономических процессов и показателей деятельности хозяйствующих субъектов
Стандартный (в дополнение к пороговому)	-прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов; -методику проведения экономического анализа деятельности хозяйствующих субъектов, содержание и последовательность проведения комплексного экономического анализа	-прогнозировать динамику основных экономических показателей; -анализировать динамику макро- и микроэкономические показатели, использовать полученные данные для решения профессиональных задач	-навыками прогнозирования экономических процессов и показателей деятельности хозяйствующих субъектов; -навыками и правилами расчета основных экономических параметров деятельности хозяйствующих субъектов, методами оценки эффективности работы хозяйствующих субъектов
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	-прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов; -методику проведения экономического анализа деятельности хозяйствующих субъектов, содержание и последовательность проведения комплексного экономического анализа;	-прогнозировать динамику основных экономических показателей; -анализировать динамику макро- и микроэкономические показатели, использовать полученные данные для решения профессиональных задач;	-навыками прогнозирования экономических процессов и показателей деятельности хозяйствующих субъектов; -навыками и правилами расчета основных экономических параметров деятельности хозяйствующих субъектов, методами оценки эффективности работы хозяйствующих субъектов;

	-порядок составления отчета о рисках	-анализировать содержание отчета о рисках	-навыками принятия управленческих решений на основании отчета о рисках
--	--------------------------------------	---	--

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Теоретические основы анализа и управления рисками	УК-6.1, УК-6.2, УК-6.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3	Оценка докладов Тестирование	Зачет
2.	Методика анализа и управления рисками	УК-6.1, УК-6.2, УК-6.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3	Оценка докладов Тестирование	Зачет

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Теоретические основы анализа и управления рисками	<ol style="list-style-type: none"> 1. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия 2. Классификация рисков: виды, принципы разработки, использование 3. Программа управления рисками: разработка и использование 4. Комплексное использование методов управления рисками 5. Управление рисками в малом предпринимательстве 6. Организация управления рисками на промышленном предприятии 7. Организация управления рисками в финансово-кредитном учреждении 8. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы 9. Особенности управления рисками транснациональной корпорации 10. Управление рисками инвестиционного проекта 11. Управление рисками в антикризисном менеджменте 12. Информационное обеспечение управления рисками: принципы создания и использования информационной системы организации. 13. Методы оценки эффективности управления рисками 14. Использование количественных методов анализа и оценки рисков 15. Использование качественных методов анализа и оценки рисков 16. Использование превентивных мероприятий по управлению рисками 17. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы 18. Инновационные технологии в управлении рисками 19. Роль субъективных факторов в управлении рисками 20. Правовое обеспечение деятельности по управлению рисками в РФ
Методика анализа и управления рисками	<ol style="list-style-type: none"> 1. Страхование как экономический механизм снижения и перераспределения риска 2. Оценка риска потери платежеспособности. 3. Оценка риска потери финансовой устойчивости. 4. Непосредственная оценка риска на основе относительных показателей. 5. Опосредованная оценка риска на основе относительных показателей. 6. Точечная оценка показателя риска. 7. Интервальная оценка показателя риска. 8. Среднее значение ожидаемого результата деятельности.

	<p>9. Показатели вариации уровня риска.</p> <p>10. Этап формирования цели и задач экспертного оценивания.</p> <p>11. Выбор метода сбора и отработки экспертной информации.</p> <p>12. Оценка согласованности мнений.</p> <p>13. Факторы финансовой несостоятельности.</p> <p>14. Динамика процесса превращения нормально функционирующего предприятия в банкрота (финансовой несостоятельности).</p> <p>15. Двухфакторная модель прогнозирования банкротства.</p> <p>16. Четырехфакторная модель прогнозирования банкротства.</p> <p>17. Шестифакторная модель прогнозирования риска потери платежеспособности.</p> <p>18. Пятифакторная модель У.Бивера.</p> <p>19. Модели диагностики банкротства предприятия.</p> <p>20. Модели прогнозирования восстановления платежеспособности предприятия.</p>
--	---

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

<https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=1090>

1. Риск – это...

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

2. Отметьте потери, которые можно отнести к трудовым

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

3. Отметьте потери, которые можно отнести к финансовым

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

4. Отметьте потери, которые можно отнести к потерям времени

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

-потери сырья

5. Отметьте потери, которые можно отнести к специальным потерям

-выплата штрафа

-ущерб здоровью

-уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

-потери ценных бумаг

-потери сырья

-уплата дополнительных налогов

-ущерб репутации

-невыполнение сроков сдачи объекта

-потери рабочего времени

-потери материалов

6. Анализ риска – это...

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

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

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

7. Идентификация риска – это...

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

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

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

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

-чистыми

-критическими

-спекулятивными

9. Последствия риска могут быть

-скорее положительными

-как положительными, так и отрицательными

-только отрицательными

10. Риски, которые практически всегда несут в себе потери, называются

-критическими

-спекулятивными

-чистыми

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

-внешними

-внутренними

-чистыми

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

-катастрофическими

-критическими

-допустимыми

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

-катастрофическими

-критическими

-допустимыми

14. Чем измеряется величина или степень риска?

-средним ожидаемым значением

-изменчивостью возможного результата

-оба варианта верны

15. Социально-экономическая функция риска состоит

- в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике - отрасли деятельности, в которых риск приемлем
 - в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода
 - оба варианта верны
16. Компенсирующая функция риска состоит
- в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике - отрасли деятельности, в которых риск приемлем
 - в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода
 - оба варианта верны
17. Защитная функция риска состоит
- в объективной необходимости законодательного закрепления понятия "правомерности риска", правового регулирования страховой деятельности
 - в том, что юридические и физические лица вынуждены искать средства и формы защиты от нежелательной реализации риска
 - оба варианта верны
18. Стимулирующая функция риска проявляется
- в том, что реализация решений с неисследованным или необоснованным риском может приводить к реализации объектов или операций, которые относятся к авантюрам
 - в исследовании источников риска при проектировании операций и систем, конструировании специальных устройств, операций, форм сделок, исключая или снижающих возможные последствия риска как отрицательного отклонения
 - оба варианта верны
19. Ущерб имуществу изначально выражается в...
- натуральном виде
 - оба варианта верны
 - денежной форме
20. Денежная форма ущерба называется
- убытком
 - упущенной выгодой
 - финансовыми потерями

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

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

	<p>20. Факторы внешней среды в управлении хозяйственным риском.</p> <p>21. Факторы внутренней среды в рискованной деятельности организации.</p> <p>22. Среда прямого воздействия на организацию.</p> <p>23. Среда косвенного воздействия на организацию.</p> <p>24. Идентификация и анализ хозяйственного риска.</p> <p>25. Методы выявления хозяйственных рисков: сущность и характеристика.</p>
Методика анализа и управления рисками	<p>1. Качественный анализ хозяйственных рисков.</p> <p>2. Количественный анализ хозяйственных рисков.</p> <p>3. Зоны хозяйственного риска.</p> <p>4. Построение кривой риска организации.</p> <p>5. Пороговые значения риска.</p> <p>6. Показатели степени риска.</p> <p>7. Экономико-статистические методы оценки риска.</p> <p>8. Метод экспертных оценок анализа хозяйственного риска. 34. Основные понятия и показатели оценки эффективности инвестиций. 35. Анализ степени риска реализации инвестиционных проектов. 36. Методы анализа риска инвестиционных проектов.</p> <p>9. Риск инвестирования в отдельный актив.</p> <p>10. Риск инвестиционного портфеля.</p> <p>11. Модель увязки систематического риска и доходности ценных бумаг CAPM (Capital Asset Pricing Model).</p> <p>12. Методы анализа риска инвестиционного портфеля.</p> <p>13. Анализ корреляционной зависимости финансовых активов в портфеле ценных бумаг.</p> <p>14. Сущность и содержание риск-менеджмента.</p> <p>15. Понятие, цель и задачи риск-менеджмента.</p> <p>16. Управление хозяйственным риском.</p> <p>17. Этапы управления хозяйственным риском.</p> <p>18. Методы управления рисками.</p> <p>19. Основные правила менеджмента риска.</p> <p>20. Методы уклонения от риска.</p> <p>21. Методы компенсации риска.</p> <p>22. Методы финансирования рисков (покрытия убытков).</p> <p>23. Принятие решения о выборе метода управления риском.</p> <p>24. Покрытие убытков на основе страхования.</p> <p>25. Содержание и виды страхования.</p>

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

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы
«зачтено»	УК-6, ПК-1, ПК-2
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне