

Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
**«ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**
(Финансовый университет)

Уфимский филиал Финуниверситета

Кафедра «Экономика, менеджмент и маркетинг»

СОГЛАСОВАНО
ООО «ХТЦ-УАИ»
Заместитель генерального директора

Р. Ф. Вагапов
«01» _____ 2021г.
МП

УТВЕРЖДАЮ
Директор Уфимского филиала

Р. М. Сафуанов
«02» _____ 2021 г.

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Рабочая программа дисциплины
для студентов, обучающихся по направлению подготовки
38.03.02 Менеджмент,
образовательная программа «Управление бизнесом»
(Менеджмент и управление бизнесом)

Рекомендовано Ученым советом филиала
(протокол № 39 от «31» августа 2021г.)

Одобрено кафедрой «Экономика, менеджмент и маркетинг»
(протокол № 1 от «27» августа 2021г.)

Уфа 2021

СОДЕРЖАНИЕ

1. Наименование дисциплины.....	4
2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения, и планируемых результатов обучения по дисциплине.....	4
3. Место дисциплины в структуре образовательной программы.....	4
4. Объем дисциплины в зачетных единицах и в академических часах с выделением объема аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся.....	5
5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объемов (в академических часах) и видов учебных занятий.....	5
5.1. Содержание дисциплины.....	5
5.2. Учебно-тематический план.....	7
5.3. Содержание семинаров, практических занятий.....	8
6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине.....	11
6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы.....	11
6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю.....	14
7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине.....	16
8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины.....	20
9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети Интернет, необходимых для освоения дисциплины.....	21
10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем.....	21
11. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем.....	22
12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине.....	22

1. Наименование дисциплины

Риск-менеджмент

2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы с указанием индикаторов их достижения, и планируемых результатов обучения по дисциплине

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции
ПКП-1	Способность планировать, организовывать и контролировать командную работу, вести деловые переговоры и реагировать на изменения	1. Демонстрирует владение методами планирования, организации и контроля командной работы	Знать организовывать работу исполнителей для выполнения работ в области риск-менеджмента Уметь планировать, организовывать и контролировать командную работу
		2. Применяет современные отечественные и зарубежные переговорные технологии в ходе деловых коммуникаций	Знать современные отечественные и зарубежные переговорные технологии, этапы проведения переговоров Уметь применять современные отечественные и зарубежные переговорные технологии в ходе деловых коммуникаций
ПКП-5	Способность оценивать риски и разрабатывать программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций	1. Демонстрирует навыки по оценке рисков и мониторинга деятельности компании	Знать понятие риска и неопределённости; основные подходы к классификации рисков; основные отечественные и зарубежные концепции менеджмента рисков; принципы управления рисками; методы нейтрализации риска Уметь идентифицировать риски; использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; пользоваться методами контроля, мониторинга и прогнозирования рисков; навыками проведения «антирисковых» мероприятий
		2. Разрабатывает программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций.	Знать программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций Уметь применять программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций

3. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к дисциплинам профиля «Менеджмент и управление бизнесом» части, формируемой участниками образовательных отношений, образовательной программы «Управление бизнесом» (Менеджмент и управление бизнесом) по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент.

4. Объем дисциплины в зачётных единицах и в академических часах с выделением объёма аудиторной (лекции, семинары) и самостоятельной работы обучающихся

Таблица 1

Очная форма обучения

Вид учебной работы по дисциплине	Всего (в з/е и часах)	Семестр 7 (в часах)
Общая трудоемкость дисциплины	4/144	144
<i>Контактная работа - Аудиторные занятия</i>	50	50
<i>Лекции</i>	16	16
<i>Семинары, практические занятия</i>	34	34
<i>Самостоятельная работа</i>	94	94
Вид текущего контроля	Контрольная работа	Контрольная работа
Вид промежуточной аттестации	экзамен	экзамен

5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) дисциплины с указанием их объёмов (в академических часах) и видов учебных занятий

5.1 Содержание дисциплины

Тема 1. Риск и неопределенность

Основные подходы к рассмотрению неопределенности. Объект, его параметры и состояние. Внешняя среда организации. Влияние факторов внешней среды на состояние объекта. Теория вероятности о неопределенности. Детерминированные и стохастические факторы, влияющие на состояние объекта. Понятия стохастической и целевой неопределенности, причины возникновения данных видов неопределенности. Субъективная оценка состояния объекта, оценочные шкалы и их виды. Мера неопределенности объекта. Энтропия, как количественная мера неопределенности системы.

Риск и его сущность. Государственный стандарт о понятии риска. Мера риска. Последствия и вероятность, как способ измерения риска. Понятие объективной и субъективной вероятности. Структура реализации риска.

Тема 2. Риски и их классификация

Основания возникновения рисков. Чистые и спекулятивные риски. Торговые, производственные, имущественные, транспортные, политические, экологические, природные риски и причины их возникновения. Транспортные (логистические) риски и их классификация в соответствии с правилами международной торговой палаты Инкотермс.

Финансовые и коммерческие риски, как составная часть спекулятивных рисков. Риски, связанные с покупательной способностью денег: инфляционные, дефляционные, валютные риски и риски ликвидности. Инвестиционные риски и их подвиды: риск упущенной выгоды, риск снижения доходности, риск прямых финансовых потерь, капитальный риск, страновой риск, временной риск. Кредитные риски и их классификация. Прочие виды рисков.

Тема 3. Управление риском

Эволюция отношения к риску в человеческом обществе. История возникновения менеджмента рисков. Переход от страхования рисков к их управлению. Показатель стоимостной оценки риска (VAR). Фрагментарная и интегрированная (корпоративная) модели управления риском. Современные концепции управления риском. Понятие риск-менеджмента. Парадигмы реализации риск-менеджмента «снизу вверх» и «сверху вниз». Жизненный цикл организации и выбор модели управления рисками. Управления рисками как процесс. Логическая схема построения и работы системы управления рисками. схема управления рисками (процесс PM) по версии Федерации европейских ассоциаций риск-менеджеров (FERMA)

Тема 4. Оценка рисков

Идентификация риска, как процесс определения, составления перечня и описания элементов риска. Описание и источники риска. Организация и ее внутренняя и внешняя среда. Внутренние и внешние источники информации для идентификации рисков. Реестр (журнал) рисков и способы его создания. Руководство по созданию реестра риска организации Р 50.1.084 – 2011. Количественная оценка (измерение) риска. Дискретные и непрерывные модели риска. Распределения случайных величин, используемые при оценке рисков. Последствия и их числовые показатели. Числовые показатели последствий экономических рисков. Методы измерения риска: статистические, вероятностно-статистические, теоретико-вероятностные, экспертные. Концепция приемлемого риска, принцип ALARA/ALARP.

Тема 5. Методы обработки риска

Классификация методов обработки риска. Составление карты (матрицы) рисков. Приемлемые и неприемлемые риски. Методы перевода риска из неприемлемого в приемлемый: уклонение от риска (risk elimination, risk avoidance),

уменьшение риска (risk reduction, risk mitigation), передача риска (risk transfer), удержание риска (risk retention). Регулирование и финансирование риска. Уклонение и уменьшение, как методы регулирования риска. Разделение и дублирование риска.

Понятие финансирования риска. Планируемые и случайные расходы по управлению риском. Классификация источников финансирования риска. Методы удержания (сохранения) и передачи (переноса) риска в целях финансирования. Осознанное и неосознанное удержание риска. Факторы влияющие на способность организации по удержанию риска. Передача риска, способы передачи риска: передача в целях регулирования риска; передача в целях финансирования риска. Механизмы передачи риска: передача риска по закону, передача риска по договору, др. механизмы передачи. Страхование, хеджирование риска.

Тема 6. Мониторинг и управление рисками

Управление рисками, как область стандартизации и средство повышения эффективности работы предприятия. Стандарты в риск менеджменте. Понятие мониторинга рисков. Два основных типа стандартов управления рисками: стандарты оценки результатов и стандарты оценки деятельности. Разработка модели внутрифирменной системы риск менеджмента. Понятие «политики управления рисками». Проверка соблюдения стандартов.

Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности, риска и неопределенности

Анализ задач и методов теории принятия решений, особенности принятия решений в управлении. Принятие решений без использования численных значений вероятностей исходов (в условиях определенности), принятие решений с использованием численных значений вероятностей исходов (в условиях неопределенности). Дерево управленческих решений.

5.2. Учебно-тематический план

Таблица 2

№ п/ п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Трудоёмкость в часах					Формы текущего контроля успеваемости
		Всего	Контактная работа- Аудиторная работа			Самостоятельная работа	
			Общая	Лекции	Семинарские занятия		
1.	Риск и неопределенность	18	5	2	4	13	опрос, дискуссия, решение тестовых заданий
2.	Риски и их классификация.	19	6	2	4	13	дискуссия, решение тестовых и практических заданий

3.	Управление риском	24	6	2	4	13	разбор кейса, решение тестовых и практических заданий
4.	Оценка рисков	23	9	3	6	14	решение ситуационных практических заданий
5.	Методы обработки риска	23	9	3	6	14	разбор кейса, решение тестовых, практических заданий и кейсов
6.	Мониторинг и управление рисками	19	6	2	4	13	опрос, решение практических заданий и кейсов
7.	Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и неопределенности	22	8	2	6	14	опрос, решение разбор кейса, практические задания
В целом по дисциплине		144	50	16	34	94	Согласно учебному плану: контрольная работа

5.3 Содержание семинаров, практических занятий

Таблица 3

Наименование тем дисциплины	Перечень вопросов для обсуждения на семинарских, практических занятиях, рекомендуемые источники	Формы проведения занятий
Тема 1. Риск и неопределенность.	1. Гост Р 51897-2011 2. Понятие риска и неопределенности. 3. Способы измерения риска. 4. Понятия измерения и шкалирования. Классификация шкал по различным основаниям. 5. Изучение различных шкал измерения параметров объекта исследования. Непрерывные и дискретные шкалы измерений параметров. 6. Четыре основных типа шкал, которые можно применять для измерения параметров объектов: номинальная, порядковая, интервальная и шкала отношений. 7. Шкалы измерений параметров с точки зрения допустимых в них операций.	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Дискуссия по теме. Групповое обсуждение тенденций и эволюции риск менеджмента менеджменте. Решение практических заданий

	Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5	
Тема 2. Классификация рисков.	<ol style="list-style-type: none"> 1. Основные признаки классификации рисков. 2. Чистые и спекулятивные риски. 3. Производственные риски и причины их возникновения. 4. Транспортные риски и их сущность. 5. Операционные и технические риски. 6. Предпринимательские риски и их особенности. 7. Финансовые риски. Расчет финансовых рисков. 8. Прочие виды рисков. <p>Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 9 № 1-3</p>	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Дискуссия по теме. Групповое обсуждение тенденций и эволюции риск менеджмента менеджменте. Решение практических заданий.
Тема 3. Управление риском	<ol style="list-style-type: none"> 1. Эволюция отношения к риску. 2. Современные концепции риск-менеджмента и понятие менеджмента-риска. 3. Фрагментированная и модель управления рисками. Переход от фрагментированной к интегрированной модели управления рисками. Сравнение фрагментированной и интегрированной моделей управления рисками 4. Характеристики системы управления рисками на разных этапах жизненного цикла организации. 5. Процесс управления рисками. Общая схема управления рисками. Логическая схема построения и работы системы управления рисками. 6. Схема управления рисками (процесс РМ) по версии Федерации европейских ассоциаций риск-менеджеров (FERMA). 7. Схема итеративного процесса оценки риска и уменьшения риска, возникающего при использовании продукции, процессов или услуг (ГОСТ Р 51898-2002 «Аспекты безопасности. Правила включения в стандарты»). <p>Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 9 № 1-3</p>	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Дискуссия по теме. Групповое обсуждение тенденций и эволюции риск менеджмента менеджменте. Решение практических заданий.
Тема 4. Оценка рисков	<ol style="list-style-type: none"> 1. Процесс «Оценка риска». Риск и его идентификация. Составления перечня и описания элементов риска. 2. Описание риска. Понятия источника риска и события. 3. Подходы к идентификации рисков. Организация процесса идентификации рисков 4. Внутренние и внешние источники информации для идентификации рисков. Классификация источников. 5. Реестр рисков. Создание реестра рисков организации. 6. Изучение ключевых рисков организации и их основных факторов на примере конкретных обществ (ПАО, АО, ООО), в соответствии с рассмотренной 	Фронтальный опрос студентов по теме занятия. Дискуссия по теме. Групповое обсуждение тенденций и эволюции риск менеджмента менеджменте. Решение практических заданий

	<p>классификацией с краткой общей характеристикой организации.</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 9 № 1-3</p>	
Тема 5. Методы обработки риска	<p>1. Измерение – количественная оценка риска. Дискретные и непрерывные модели риска.</p> <p>2. Законы распределения случайных величин, используемые при оценке рисков.</p> <p>3. Изучения равномерного закона распределения и его свойств на основе табличного процессора MS Excel</p> <p>4. Изучения нормального закона распределения и его свойств на основе табличного процессора MS Excel.</p> <p>5. Изучение биномиального закона распределения и его свойств на основе табличного процессора MS Excel.</p> <p>6. Расчет практико-ориентированного задания по имитационному моделированию рисков проекта.</p> <p>7. Методы обработки риска.</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 9 № 1-3</p>	<p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия.</p> <p>Дискуссия по теме. Групповое обсуждение тенденций и эволюции риск менеджмента менеджменте. Решение практических заданий Тестирование.</p>
Тема 6. Мониторинг и управление рисками	<p>1. Управление риском и его сущность.</p> <p>2. Управление техническими и производственными рисками.</p> <p>3. Особенности управления социальными рисками.</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 9 № 1-3</p>	<p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия.</p> <p>Дискуссия по теме. Групповое обсуждение тенденций и эволюции риск менеджмента менеджменте. Решение практических заданий</p>
Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и неопределенности	<p>1. Решение задач принятия решений без использования численных значений вероятностей исходов, с использованием вероятностей и по методу Парето.</p> <p>2. Графическое отображение процесса принятия решений - дерево управленческих решений.</p> <p>3. Расчет показателя VAR на основе табличного процессора MS Excel.</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5</p> <p>Рекомендуемые источники: раздел 9 № 1-3</p>	<p>Фронтальный опрос студентов по теме занятия.</p> <p>Дискуссия по теме. Групповое обсуждение тенденций и эволюции риск менеджмента менеджменте. Решение практических заданий Тестирование.</p>

6. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

6.1. Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение дисциплины, формы внеаудиторной самостоятельной работы

Таблица 4

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение	Формы внеаудиторной самостоятельной работы
Тема 1. Риск и неопределенность	Энтропия, как мера неопределенности объекта. Шкалы измерения параметров. Основные типы шкал, применяемые для измерения параметров объектов: номинальная, порядковая, интервальная и шкала отношений. Рекомендуемые источники: 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5 9 № 1-3	Работа с конспектом лекции; работа с электронной библиотечной системой; работа с информационно образовательным порталом (ИОП) Финуниверситета; подготовка к тестированию; подготовка к решению ситуационных задач; подготовка к решению кейса.
Тема 2. Классификация рисков	Транспортные (логистические) риски и их классификация в соответствии с правилами международной торговой палаты Инкотермс. Стратегические риски и стратегическая безопасность. SWOT-анализ, как метод снижения стратегических рисков. Рекомендуемые источники: 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5 9 № 1-3	Работа с конспектом лекции; работа с электронной библиотечной системой; работа с информационно образовательным порталом (ИОП) Финуниверситета; подготовка к тестированию; подготовка к решению ситуационных задач; подготовка к решению кейса.
Тема 3. Управление риском	Стандарты управления рисками FERMA. Итеративный процесс оценки риска и уменьшения риска, возникающего при использовании продукции, процессов или услуг (ГОСТ Р 51898-2002 «Аспекты безопасности. Правила включения в стандарты» вводится). Рекомендуемые источники: 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5 9 № 1-3	Работа с конспектом лекции; работа с электронной библиотечной системой; работа с информационно образовательным порталом (ИОП) Финуниверситета; подготовка к тестированию; подготовка к решению ситуационных задач; подготовка к решению кейса.

Наименование тем (разделов) дисциплины	Перечень вопросов, отводимых на самостоятельное освоение	Формы внеаудиторной самостоятельной работы
Тема 4. Оценка рисков	Инвестиции. Экономическая сущность инвестиций и их функции. Инвестиционные риски. Теоретические основы инвестиционных рисков. Оценка рисков инвестиционных проектов на предприятии. Рекомендуемые источники: 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5 9 № 1-3	Работа с конспектом лекции; работа с электронной библиотечной системой; работа с информационно образовательным порталом (ИОП) Финуниверситета; подготовка к тестированию; подготовка к решению ситуационных задач; подготовка к решению кейса.
Тема 5. Методы обработки риска	Страхование. Экономическая сущность страхования. Виды и функции страхования. Страхование, как способ передачи риска по договору страхования. Рекомендуемые источники: 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5 9 № 1-3	Работа с конспектом лекции; работа с электронной библиотечной системой; работа с информационно образовательным порталом (ИОП) Финуниверситета; подготовка к тестированию; подготовка к решению ситуационных задач; подготовка к решению кейса.
Тема 6. Мониторинг и управление рисками	Управление рисками проекта. Анализ проблем проекта. Инструменты мониторинга рисков проекта. Разработка системы управления рисками проектов. Рекомендуемые источники: 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5 9 № 1-3	Работа с конспектом лекции; работа с электронной библиотечной системой; работа с информационно образовательным порталом (ИОП) Финуниверситета; подготовка к тестированию; подготовка к решению ситуационных задач; подготовка к решению кейса.
Тема 7. Принятие управленческих решений в условиях определенности риска и неопределенности	Управленческое решение и его сущность. Влияние риска на принятие управленческого решения. Рекомендуемые источники: 8 № 1, 2, 3, 1, 2, 3, 4, 5 9 № 1-3	Работа с конспектом лекции; работа с электронной библиотечной системой; работа с информационно образовательным порталом (ИОП) Финуниверситета; подготовка к тестированию; подготовка к решению ситуационных задач; подготовка к решению кейса.

6.2. Перечень вопросов, заданий, тем для подготовки к текущему контролю

Примерная тематика контрольной работы

1. Провести интернет-исследование по основным терминам, встречающимся в риск-менеджменте, и составить краткий терминологический словарь
2. Провести интернет-исследование о персоналиях, внесших наиболее важные вклады в развитие теории и практики риск-менеджмента

3. История развития математических методов риск-менеджмента
4. Сопоставление развития отрасли услуг по риск-менеджменту в России и в развитых странах Запада
5. Концепция фрактальности в науке и бизнесе
6. Основы целостного подхода к управлению организацией
7. Анализ организационной структуры реальной организации и её фрактальное представление
8. Анализ жизненных циклов конкретной организации
9. Состав и динамика влияния стейкхолдеров организации
10. Подходы к разработке рискованного ландшафта конкретной организации
11. Концепция рисков типа «чёрный лебедь»
12. Влияние хорошей системы управления рисками на инвестиционную, заёмную, рыночную, технологическую мощь фирмы
13. Пути сокращения резервов в пользу более продуктивных активов за счёт раннего оповещения в системе управления рисками
14. Снижение потерь за счёт более профессиональных оценок рисков фирмы и усиления позиций в диалогах со страховщиками
15. Влияние состояния риск-менеджмента в фирме на лояльность персонала
16. Влияние состояния риск-менеджмента в фирме на закрепление клиентуры
17. Влияние состояния риск-менеджмента в фирме на укрепление отношений с партнёрами и поставщиками
18. Пути создания системы управления рисками в коммерческой организации
19. Ситуационное управление в системе риск-менеджмента коммерческой организации
20. Разработка системы страхования рисков фирмы
21. Распределение обязанностей по управлению рисками в коммерческой организации
22. Методы выявления и измерения критических индикаторов риска в коммерческой организации
23. Человеческая компонента в управлении рисками
24. Поведение людей в рискованных ситуациях
25. Человек как источник риска в бизнесе
26. Типология типов личности по отношению к рискам
27. Применение принципа «проверок и балансировки» к построению системы управления рисками организации
28. Оценка рисков в методике оценки стоимости фирмы
29. Финансовые риски коммерческих фирм
30. Финансовые риски на разных этапах жизненного цикла фирмы
31. История и направленность Базельского процесса в мировой практике
32. Участие России в Базельском процессе
33. Базельские соглашения как инструмент регулирования устойчивости экономики страны и мировой экономики

34. Выгоды и издержки внедрения Базельской системы оценки рисков позиций банков
35. Методы манипулирования операционными рисками фирмы
36. Методы манипулирования финансовыми рисками фирмы
37. Методы обнаружения и манипулирования рисками мошенничества
38. Методы диагностики рисков коммерческой организации
39. Методы диагностики и элиминирования фатальных рисков организации
40. Система стандартизации риск-менеджмента в США, Канаде, Великобритании, Австралии, ЮАР (выбрать одну страну)
41. Направления стандартизации риск-менеджмента в коммерческих организациях
42. Разработка системы внутренних стандартов по управлению рисками в фирме
43. Роль воспитания кадров в обеспечении адекватности рисков поведения организации
44. Проект создания целостной системы управления в конкретной организации
45. Разработка личной системы адекватной защиты от рисков
46. Способы накопления и обобщения опыта управления рисками в бизнесе

Критерии балльной оценки различных форм текущего контроля успеваемости содержатся в соответствующих методических рекомендациях кафедры.

7. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине содержится в разделе «2. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине».

Таблица 5

Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (умения и знания), соотнесенные с компетенциями/индикаторами достижения компетенции	Типовые контрольные задания
ПКП-1Способность планировать, организовывать и контролировать командную	1. Демонстрирует владение методами планирова-	Знать организовывать работу исполнителей для выпол-	К чистым рискам относятся ... а) торговые б) производственные в) имущественные г) инфляционные

<p>работу, вести деловые переговоры и реагировать на изменения</p>	<p>ния, организации и контроля командной работы</p>	<p>нения работ в области риск-менеджмента Уметь планировать, организовывать и контролировать командную работу</p>	<p>д) дефляционные е) ликвидности Задание 1. Оцените валютные риски компании ПАО «Антал» собирающейся инвестировать средства в валютные активы. Если курс доллара США к российскому рублю равен 58,49 руб. /долл., простая процентная ставка для долларовых инвестиций составляет 6% годовых, а для рублевых – 8%, то каков должен быть обменный курс доллара к рублю через год, чтобы рублевые инвестиции в американские активы вышли на уровень безубыточности?</p>
	<p>2. Применяет современные отечественные и зарубежные переговорные технологии в ходе деловых коммуникаций</p>	<p>Знать современные отечественные и зарубежные переговорные технологии, этапы проведения переговоров Уметь применять современные отечественные и зарубежные переговорные технологии в ходе деловых коммуникаций</p>	<p>К спекулятивным рискам относятся ... а) торговые б) производственные в) имущественные г) инфляционные д) дефляционные е) ликвидности Задание 2. Оцените валютные риски российской компании собирающейся инвестировать средства в валютные активы. Если курс доллара США к российскому рублю равен 59,13 руб. /долл., простая процентная ставка для долларовых инвестиций составляет 6,5% годовых, а для рублевых – 8,5%, то каков должен быть обменный курс доллара к рублю через год, чтобы рублевые инвестиции в американские активы превысили уровень безубыточности на 3%?</p>
<p>ПКП-5 Способность оценивать риски и разрабатывать программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций</p>	<p>1. Демонстрирует навыки по оценке рисков и мониторинга деятельности компании</p>	<p>Знать понятие риска и неопределённости; основные подходы к классификации рисков; основные отечественные и зарубежные концепции менеджмента рисков; принципы управления рисками; методы нейтрализации риска</p>	<p>Инвестиционные риски относятся к ... рискам. а) торговым б) производственным в) чистым г) инфляционным д) дефляционным е) спекулятивным Задание 3. С каким риском сталкивается автолюбитель, приобретающий автомобиль стоимостью 20 000 евро и имеющий привычку менять авто-</p>

		Уметь идентифицировать риски; использовать методы количественного и качественного анализа рисков; управлять предпринимательскими рисками; пользоваться методами контроля, мониторинга и прогнозирования рисков; навыками проведения «антирисковых» мероприятий	мобиль каждые три года, если стоимость аренды автомобиля составляет 4000 евро в год, а банковская процентная ставка равна 10%. Как можно этим риском управлять?
	2. Разрабатывает программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций.	Знать программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций Уметь применять программу превентивных мер для предупреждения и снижения отрицательных последствий кризисных ситуаций	Биржевые риски относятся к ... рискам. а) торговым б) производственным в) инвестиционным г) инфляционным д) дефляционным е) спекулятивным Задание 4. Охарактеризуйте современный этап глобализации мировой экономики. Какие риски он для транснациональных корпораций и национальных государств?

Вопросы для подготовки к экзамену:

1. Риск - менеджмент как отрасль научного управления.
2. Основные направления риск-менеджмента.
3. Цель и задачи дисциплины риск-менеджмента.
4. История возникновения дисциплины риск-менеджмента.
5. Законы и принципы дисциплины риск-менеджмента.
6. Механизм формирования принципов управления.
7. Функции риск-менеджмента.
8. Измерение риска. Шкалы измерений параметров.
9. Сущность управленческих решений.
10. Риск и неопределенность.
11. Неопределенность информации и понятие энтропии.
12. Риски и их классификация.
13. Логистические риски. Классификация логистических рисков.
14. Риски маркетинговой деятельности.
15. Финансовые риски.

16. Инфляционные и дефляционные риски.
17. Подготовка, принятие и реализация управленческих решений.
18. Зоны риска и принятие управленческих решений.
19. Методы разработки и принятия управленческих решений в системе риск-менеджмента.
20. Международные стандарты менеджмента рисков.
21. Стратегия управления рисками.
22. Политика риск-менеджмента хозяйствующего субъекта.
23. Основные формы политики риск-менеджмента.
24. Сущность тактического управления рисками.
25. Внутренние риски хозяйствующего субъекта.
26. Мониторинг рисков и его сущность.
27. Основные виды административных рисков.
28. Управление риском и его сущность.
29. Управление техническими и производственными рисками.
30. Особенности управления социальными рисками.
31. Характеристика и структура внешней среды хозяйствующего субъекта.
32. Политические риски и их классификация.
33. Сущность экономического риска и риск - менеджмент.
34. Природные риски и их влияние на экономику.
35. Национальные риски в современном менеджменте.
36. Экологические риски. Управление экологическими рисками.
37. Специфика демографических рисков.
38. Влияние криминогенных рисков на развитие бизнеса.
39. Отраслевые и структурные риски.
40. Оценка риска на основе расчета порога рентабельности и запаса финансовой прочности.
41. Оценка риска на основе эффекта операционного рычага.
42. Оценка риска на основе кривой спроса и линии безубыточного прироста продаж.
43. Оценка риска на основе эффекта финансового рычага.
44. Метод составления матрицы последствий и матрицы рисков.
45. Риск и критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: критерий минимакса.
46. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: критерий Сэвиджа.
47. Критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: правило Гурвица (α -критерий)
48. Риск и критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: критерий Байеса-Лапласа
49. Диверсификации портфеля ценных в условиях неопределенности валютного рынка.
50. Количественная оценка рисков альтернативных вариантов инвестирования.

8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

Основная литература:

1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент: учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: Издательство Юрайт, 2021. - 365 с.- URL: <https://ez.el.fa.ru>:
2. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент: учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. - 7-е изд. - Москва -: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - 372 с. - URL: <https://znanium.com/c>
3. Окулов, В. Л. Риск-менеджмент: основы теории и практика применения: учебное пособие / В. Л. Окулов. – СПб.: Изд-во С.-Петербур. ун-та, 2019. - 280 с. - URL: <https://znanium.com/>

Дополнительная

1. Основы риск-менеджмента / М. Кроуи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк. - Москва: Издательство Юрайт, 2020. - 390 с. - URL: <https://ez.el.fa.ru>:
2. Киселев, А.А. Риск-менеджмент: учебник / Киселев А.А. - Москва: КноРус, 2021. - 167 с.- URL: <https://book.ru/>
3. Чеботарева, Г.С. Отраслевой риск-менеджмент: учебное пособие / Чеботарева Г.С. - Москва: КноРус, 2021. - 146 с.- URL: <https://book.ru/>
4. Федорова, А.В. Риск-менеджмент (для менеджеров): учебное пособие / Федорова А.В. - Москва: КноРус, 2021. - 212 с. - ISBN 978-5-406-08541-7. - URL: <https://book.ru/>
5. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент: учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. - 7-е изд. - Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2020. - 372 с. - URL: <https://znanium.com/>

9. Перечень ресурсов информационно телекоммуникационной сети «интернет», необходимых для освоения дисциплины:

1. Официальный сайт Центрального банка Российской Федерации (Банк России): аналитические материалы. <http://www.cbr.ru>
2. Мониторинг экономических показателей. <http://www.budgetrf.ru>
3. Официальный сайт Правительства Российской Федерации. <http://www.government.ru>
4. Официальный сайт министерства экономического развития Российской Федерации. <http://www.economy.gov.ru>
5. Официальный сайт Министерства финансов Российской Федерации. <http://www.minfin.ru>
6. Сайт Федеральной налоговой службы России. <http://www.nalog.ru>
7. Федеральная служба государственной статистики (ФСГС) России. <http://www.gks.ru/>
8. Электронный каталог Российской государственной библиотеки. <http://www.rsl.ru>

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Наименование методических материалов для обучающихся	Год утверждения	Местонахождение материала (ссылка на ИОП, информационный стенд кафедры/филиала, др.)
Методические указания к лекциям	2021	http://www.fa.ru/fil/ufa/about/ums/Pages/info.aspx
Методические указания к практическим занятиям	2021	http://www.fa.ru/fil/ufa/about/ums/Pages/info.aspx
Методические указания самостоятельной работе	2021	http://www.fa.ru/fil/ufa/about/ums/Pages/info.aspx
Методические указания к контрольной работе	2021	http://www.fa.ru/fil/ufa/about/ums/Pages/info.aspx

11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень необходимого программного обеспечения и информационных справочных систем

11.1. Комплект лицензионного программного обеспечения:

Продукты компании Microsoft, включая ОС Windows и Office.

11.2. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Электронное периодическое издание Справочная Правовая Система Консультант Бюджетные организации: версия Проф.

11.3 Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации

Сертифицированные программные и аппаратные средства защиты информации – не используются.

12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине.

Учебная аудитория для проведения всех видов занятий, предусмотренных программой бакалавриата, оснащенная оборудованием и техническими средствами обучения.