

Рубцовский индустриальный институт (филиал)
федерального государственного бюджетного образовательного учреждения
высшего образования
«Алтайский государственный технический университет им. И.И. Ползунова»

СОГЛАСОВАНО

Декан ТФ

А.В. Сорокин

Рабочая программа дисциплины

Код и наименование дисциплины: **Б1.В.ДВ.8.1 «Риск -менеджмент»**

Код и наименование направления подготовки (специальности): **38.03.01**

Экономика

Направленность (профиль, специализация): **Финансы и кредит**

Статус дисциплины: **дисциплины (модули) по выбору**

Форма обучения: **заочная**

Статус	Должность	И.О. Фамилия
Разработал	старший преподаватель	Е.В. Дирша
Согласовал	Зав. кафедрой «ЭиУ»	Д.В. Ремизов
	руководитель направленности (профиля) программы	Д.В. Ремизов

г. Рубцовск

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

Код компетенции из УП и этап её формирования	Содержание компетенции	В результате изучения дисциплины обучающиеся должны:		
		знать	уметь	владеть
ОК-7	способностью к самоорганизации и самообразованию	Различные подходы к управлению рисками разных сфер деятельности хозяйствующих субъектов	Использовать знания в области риск-менеджмента для повышения своего мастерства в выявлении путей достижения оптимального соотношения между риском и доходом	Основами теории и методологии управления рисками и навыками развития своих знаний
ОПК-4	способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Место риск-менеджмента в системе управления предприятием; виды рисков; основные подходы к управлению рисками; методы управления рисками	Принимать организационно-управленческих решения в области управления рисками	Методами принятия организационно-управленческих решений в области управления рисками
ПК-1	способностью собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	Основные показатели, характеризующие уровень риска деятельности хозяйствующих субъектов; методы сбора информации, необходимой для их расчета	Осуществлять поиск информации, сбор и анализ данных, необходимых для расчета показателей, характеризующих уровень риска деятельности хозяйствующих субъектов	Навыками сбора, обработки и анализа данных, необходимых для расчета показателей, характеризующих уровень риска деятельности хозяйствующих субъектов
ПК-11	способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их	Методы оценки и анализа рисков и их возможных социально-экономических последствий;	Применять знания в области анализа рисков, формирования подходов и выбора методов управления	Методами оценки и анализа рисков, и методами управления рисками

	совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	основные подходы к	рисками при оценке	
ПК-2	способностью на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	Методы оценки и анализа основных показателей, характеризующих уровень риска деятельности хозяйствующих субъектов	Рассчитывать основные показатели, характеризующие уровень риска деятельности хозяйствующих субъектов	Методами оценки и анализа основных показателей, характеризующих уровень риска деятельности хозяйствующих субъектов

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплины (практики), предшествующие изучению дисциплины, результаты освоения которых необходимы для освоения данной дисциплины.	Инвестиции, Менеджмент, Статистика
Дисциплины (практики), для которых результаты освоения данной дисциплины будут необходимы, как входные знания, умения и владения для их изучения.	Оценка стоимости бизнеса, Финансовый менеджмент

3. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающегося с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающегося

Общий объем дисциплины в з.е. /час: 5 / 180

Форма обучения	Виды занятий, их трудоемкость (час.)				Объем контактной работы
	Лекции	Лабораторные	Практические	Самостоятельна	

		работы	занятия	я работа	обучающегося с преподавателем
заочная	12	0	12	156	30

4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

Форма обучения: заочная

Семестр: 9

Объем дисциплины в семестре з.е. /час: 2 / 72

Форма промежуточной аттестации: Зачет

Виды занятий, их трудоемкость (час.)				Объем контактной работы обучающегося с преподавателем (час)
Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия	Самостоятельная работа	
8	0	8	56	18

Лекционные занятия (8ч.)

1. Риск как экономическая категория {беседа} (2ч.)[1,2,3,4] Эволюция представлений о риске. Понятие риска, его функции. Объективная и субъективная стороны риска. Способность к самоорганизации и самообразованию. Структурные характеристики риска: опасность, подверженность риску, уязвимость, взаимодействие с другими рисками

2. Виды и классификация рисков {беседа} (2ч.)[1,2,3,4] Обзор основных подходов к классификации рисков. Классификация рисков по основным сферам, областям деятельности предприятия. Основные виды банковских рисков. Основные виды производственных рисков. Организационно-управленческие решения в разрезе определения производственных рисков.

3. Сущность и содержание риск-менеджмента {беседа} (2ч.)[1,2,3,4] Понятие риск-менеджмента, его цель и задачи. Стратегия и тактика риск-менеджмента. Содержание основных подходов к управлению рисками (активного, адаптивного, консервативного).

4. Сущность и содержание риск-менеджмента {беседа} (2ч.)[1,2,3,4] Субъект и объект в системе управления риском. Функциональная структура риск-менеджмента: исполнительный и координирующий уровни. Организационная структура риск-менеджмента. Основные подходы к организации риск-

менеджмента.

Практические занятия (8ч.)

1. Риск как экономическая категория {беседа} (2ч.)[1,2,4] Дискуссия по теме:

1. Основные положения классической и неоклассической теорий риска.
2. История развития проблемы риска в отечественной экономической науке.
3. Различные толкования понятия «риск».
4. Основные функции риска.
5. Разница между риском и неопределенностью согласно информационному подходу.
6. Разница между риском и неопределенностью согласно оценочному подходу.
7. Объективная и субъективная основа риска.
8. Структурные характеристики риска.

Анализ конкретных ситуаций.

2. Виды и классификация рисков {беседа} (2ч.)[1,2,4] Опрос по теме:

1. Основные признаки классификации рисков.
2. Виды риска в зависимости от сферы деятельности предприятия.
3. Основные виды производственных рисков.
4. Основные виды банковских рисков.

Заслушивание докладов на темы: «Виды рисков, специфика и управление рисками в банковской деятельности», «Управление рисками в страховом бизнесе», «Управление инвестиционными рисками», «Производственные риски».

Анализ конкретных ситуаций.

3. Контрольная точка – написание теста по темам: «Риск как экономическая категория», «Виды и классификация рисков» {тренинг} (2ч.)[1,2,4]

Контрольная точка – написание теста по темам: «Риск как экономическая категория», «Виды и классификация рисков»

4. Сущность и содержание риск-менеджмента {беседа} (2ч.)[1,2,4] Дискуссия по теме:

1. Понятие риск-менеджмент, его цель и задачи.
2. Субъект и объект управления риском.
3. Подходы к управлению рисками.
4. Функциональная структура риск-менеджмента.
5. Организационная структура риск-менеджмента, охарактеризуйте ее основные

элементы.

6. На каком уровне должно осуществляться управление рисками, почему?

Заслушивание докладов на темы: «История возникновения риск-менеджмента», «Управление риском как часть общего менеджмента фирмы»

Анализ конкретных ситуаций.

Самостоятельная работа (56ч.)

1. Изучение темы "Управление рисками в системе риск-менеджмента"(8ч.) [1,2,4] Свойства системы управления риском. Основные принципы и правила управления рисками. Развитие концепции управления риском. Цели и задачи системы управления риском. Ограничения системы управления риском (внешние и внутренние). Способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности в активном и пассивном управлении рисками. Основные этапы управления рисками. Возможные социально-экономические последствия процесса управления рисками.

2. Изучение темы "Оценка и анализ рисков в системе риск-менеджмента "(8ч.)[1,2,3,4] Качественная оценка рисков: факторы риска (внешние факторы прямого и косвенного воздействия, внутренние объективные и субъективные факторы), причины риска.

Картографирование рисков, экспертные методы оценки рисков, сбор и анализ исходных данных необходимых для статистических методов оценки рисков, концепция рисковой стоимости Value at Risk (VaR) и Risk Metrics, сценарный анализ, анализ чувствительности, методы имитационного моделирования и др., для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

3. Выполнение контрольной работы(32ч.)[1,2,3,4]

4. Защита контрольной работы(4ч.)[1]

5. Подготовка к зачету(4ч.)[1,2,3,4]

Семестр: 10

Объем дисциплины в семестре з.е. /час: 3 / 108

Форма промежуточной аттестации: Экзамен

Виды занятий, их трудоемкость (час.)	Объем контактной работы
--------------------------------------	-------------------------

Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия	Самостоятельная работа	обучающегося с преподавателем (час)
4	0	4	100	12

Лекционные занятия (4ч.)

1. Методы управления риском {беседа} (2ч.)[1,2,3,4] Классификация методов управления рисками.

Методы трансформации рисков. Метод отказа от риска. Метод снижения частоты ущерба или предотвращения убытка. Метод уменьшения размера убытков. Метод разделения риска. Метод аутсорсинга риска.

Методы финансирования рисков. Расчет на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы: Покрытие убытка из текущего дохода. Покрытие убытка из резервов. Покрытие убытка за счет использования займа. Покрытие убытка на основе самострахования. Покрытие убытка на основе страхования. Покрытие убытка на основе нестрахового пула. Покрытие убытка за счет передачи ответственности на основе договора. Покрытие убытка на основе поддержки государственных и/или муниципальных органов. Покрытие убытка на основе спонсорства.

2. Методы управления риском {беседа} (2ч.)[1,2,3,4] Покрытие убытка на основе самострахования. Покрытие убытка на основе страхования. Покрытие убытка на основе нестрахового пула. Покрытие убытка за счет передачи ответственности на основе договора. Покрытие убытка на основе поддержки государственных и/или муниципальных органов. Покрытие убытка на основе спонсорства.

Практические занятия (4ч.)

1. Методы управления рисками {беседа} (2ч.)[1,2,3,4] Опрос по теме:

1. Назовите основные подходы к классификации методов управления рисками?
2. Назовите методы трансформации рисков? Приведите примеры.
3. Назовите методы финансирования рисков? Приведите примеры.

2. Методы управления рисками {беседа} (2ч.)[1,2,3,4] Заслушивание докладов на темы: «Зарубежный опыт риск-менеджмента»

Анализ конкретных ситуаций.

Самостоятельная работа (100ч.)

- 1. Изучение темы "Особенности управления финансовыми рисками предприятия "(47ч.)[1,2,3,4]** Экономическая сущность и классификация финансовых рисков предприятия. Сущность и задачи управления финансовыми рисками. Методический инструментарий учета фактора риска в финансовых операциях. Методы обоснования управленческих решений в условиях риска и неопределенности. Механизмы нейтрализации финансовых рисков на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы.
- 2. Выполнение контрольной работы(40ч.)[1,2,3,4]**
- 3. Защита контрольной работы(4ч.)[1]**
- 4. Подготовка к экзамену(9ч.)[1,2,3,4]**

5. Перечень учебно-методического обеспечения самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Для каждого обучающегося обеспечен индивидуальный неограниченный доступ к электронно-библиотечным системам: Лань, Университетская библиотека он-лайн, электронной библиотеке АлтГТУ и к электронной информационно-образовательной среде:

1. Гвоздева Е.А. Риск-менеджмент: учебное пособие для студентов всех форм обучения направления подготовки «Экономика»/Е.А. Гвоздева, А.В. Сорокин; Рубцовский индустриальный институт. - 2-е изд. доп. и испр. – Рубцовск: РИИ, 2021. – 84 с. URL: https://edu.rubinst.ru/resources/books/Gvozdeva_E.A._Risk-menedzhment_UP_2021.pdf (дата обращения 16.08.2021)

6. Перечень учебной литературы

6.1. Основная литература

2. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев. – 7-е изд. – Москва : Дашков и К°, 2020. – 372 с. : ил. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=573397> (дата обращения: 19.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-394-03820-4. – Текст : электронный.

6.2. Дополнительная литература

3. Суворова, А. П. Риск-менеджмент : учебное пособие / А. П. Суворова, О. М. Репина ; Поволжский государственный технологический университет. –

Йошкар-Ола : Поволжский государственный технологический университет, 2018. – 176 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=560489> (дата обращения: 19.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-8158-2036-4. – Текст : электронный.

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

4. <https://riskmanager.ru/>

8. Фонд оценочных материалов для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

Содержание промежуточной аттестации раскрывается в комплекте контролирующих материалов, предназначенных для проверки соответствия уровня подготовки по дисциплине требованиям ФГОС, которые хранятся на кафедре-разработчике РПД в печатном виде и в ЭИОС.

Фонд оценочных материалов (ФОМ) по дисциплине представлен в приложении А.

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

Для успешного освоения дисциплины используются ресурсы электронной информационно-образовательной среды, образовательные интернет-порталы, глобальная компьютерная сеть Интернет. В процессе изучения дисциплины происходит интерактивное взаимодействие обучающегося с преподавателем через личный кабинет студента.

№пп	Используемое программное обеспечение
1	Windows
2	LibreOffice
3	Антивирус Kaspersky

№пп	Используемые профессиональные базы данных и информационные справочные системы
1	Бесплатная электронная библиотека онлайн "Единое окно к образовательным ресурсам" для студентов и преподавателей; каталог ссылок на образовательные интернет-ресурсы (http://Window.edu.ru)
2	Национальная электронная библиотека (НЭБ) — свободный доступ читателей к

фондам российских библиотек. Содержит коллекции оцифрованных документов (как открытого доступа, так и ограниченных авторским правом), а также каталог изданий, хранящихся в библиотеках России. (http://нэб.рф/)

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

Наименование специальных помещений и помещений для самостоятельной работы
учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа
учебные аудитории для проведения занятий семинарского типа
помещения для самостоятельной работы
учебные аудитории для проведения групповых и индивидуальных консультаций
учебные аудитории для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации

Материально-техническое обеспечение и организация образовательного процесса по дисциплине для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья осуществляется в соответствии с «Положением об обучении инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья».

ПРИЛОЖЕНИЕ А
ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ МАТЕРИАЛОВ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ
ПО ДИСЦИПЛИНЕ «Риск -менеджмент»

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

Код контролируемой компетенции	Способ оценивания	Оценочное средство
ОК-7: способностью к самоорганизации и самообразованию	Зачет; экзамен	Комплект контролирующих материалов для зачета; комплект контролирующих материалов для экзамена
ОПК-4: способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность	Зачет; экзамен	Комплект контролирующих материалов для зачета; комплект контролирующих материалов для экзамена
ПК-1: способностью собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	Зачет; экзамен	Комплект контролирующих материалов для зачета; комплект контролирующих материалов для экзамена
ПК-11: способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	Зачет; экзамен	Комплект контролирующих материалов для зачета; комплект контролирующих материалов для экзамена
ПК-2: способностью на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность	Зачет; экзамен	Комплект контролирующих материалов для зачета; комплект контролирующих

хозяйствующих субъектов		материалов для экзамена
-------------------------	--	-------------------------

2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Показатели оценивания компетенций представлены в разделе «Требования к результатам освоения дисциплины» рабочей программы дисциплины «Риск -менеджмент» с декомпозицией: знать, уметь, владеть.

При оценивании сформированности компетенций по дисциплине «Риск -менеджмент» используется 100-балльная шкала.

Критерий	Оценка по 100-балльной шкале	Оценка по традиционной шкале
Студент твёрдо знает программный материал, системно и грамотно излагает его, демонстрирует необходимый уровень компетенций, чёткие, сжатые ответы на дополнительные вопросы, свободно владеет понятийным аппаратом.	75-100	<i>Отлично</i>
Студент проявил полное знание программного материала, демонстрирует сформированные на достаточном уровне умения и навыки, указанные в программе компетенции, допускает непринципиальные неточности при изложении ответа на вопросы.	50-74	<i>Хорошо</i>
Студент обнаруживает знания только основного материала, но не усвоил детали, допускает ошибки, демонстрирует не до конца сформированные компетенции, умения систематизировать материал и делать выводы.	25-49	<i>Удовлетворительно</i>
Студент не усвоил основное содержание материала, не умеет систематизировать информацию, делать необходимые выводы, чётко и грамотно отвечать на заданные вопросы, демонстрирует низкий уровень овладения необходимыми компетенциями.	<25	<i>Неудовлетворительно</i>

3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности.

№ пп	Вопрос/Задача	Проверяемые компетенции
1	<p>На основе способности к самоорганизации и самообразованию выбрать верные ответы. Основной целью риск-менеджмента является:</p> <p>а) оценка воздействия рисков б) разработка и реализация стратегии управления риском с) снижение опасности принятия ошибочного решения и уменьшение возможных негативных последствий нежелательного развития событий</p> <p>На основе способности к самоорганизации и самообразованию выбрать верные ответы. На координирующем (высшем) уровне реализуются следующие функции риск-менеджмента:</p> <p>а) контроль риска функционирования предприятия б) управление риском при подготовке решений согласование направлений деятельности всех звеньев подсистемы управления риском</p> <p>На основе способности к самоорганизации и самообразованию выбрать верные ответы. Рисковую ситуацию характеризует:</p> <p>а) случайный вероятностный характер события б) наличие альтернативных решений с) 100%-я вероятность возникновения убытков д) 50%-я вероятность получения дополнительной прибыли</p>	ОК-7
2	<p>На основе способности находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовности нести за них ответственность выбрать верные ответы.</p> <p>В качестве управляемого объекта подсистемы управления риском может выступать:</p> <p>а) предприятие б) информационные потоки с) сотрудники предприятия</p>	ОПК-4

	<p>d) все вышеперечисленное</p> <p>На основе способности находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовности нести за них ответственность выбрать верные ответы. Риск, оказывающий одинаковое воздействие на все фирмы независимо от их размера, называют:</p> <p>a) специфическим b) систематическим c) мультипликативным d) аддитивным.</p> <p>На основе способности находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовности нести за них ответственность выбрать верные ответы. Информационная основа для всей процедуры риск-менеджмента формируется на этапе:</p> <p>a) мониторинга результатов и совершенствования системы управления рисками b) идентификации и анализа рисков c) анализа альтернативных методов управления риском</p> <p>9. Методика Risk Metrics наиболее применима, когда:</p> <p>a) капитал инвестирован в два и более видов активов; b) доходность вложений зависит и определяется несколькими параметрами; c) доходность вложений определяется одним параметром; d) капитал инвестирован в один вид активов.</p>	
3	<p>На основе способности собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов выбрать верные ответы. Факторы риска — это:</p> <p>a) условия, способствующие проявлению причин риска;</p>	ПК-1

	<p>b) источники возникновения риска; c) возникновение специфического набора обстоятельств, при которых происходит данное явление.</p> <p>На основе способности собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов выбрать верные ответы. Какие из перечисленных позиций изучаются при выявлении внутрен-них факторов риска?</p> <p>a) инфраструктура рынка, нормативно-правовая база, уровень предпринимательской активности в регионе; b) тенденции изменения конъюнктуры рынка, структуры по-ребления; c) состояние материально-технической базы предприятия (орга-низации); d) уровень соответствия используемых технологий (производст-венных, информационных и т. д.) современным инновацион-ным разработкам, достижениям в области науки и техники.</p> <p>На основе способности собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов выбрать верные ответы. Выделите основные факторы риска не востребо-ванности продукции:</p> <p>a) изменение социально-экономической ситуации; b) демографический фактор; c) платежеспособность потребителя; d) отсутствие развитой системы страхования финансовых опе-раций.</p>	
4	<p>На основе способности критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных</p>	ПК-11

	<p>социально-экономических последствий выбрать верные ответы.</p> <p>5. Реализация мероприятий по управлению рисками может противоречить деятельности основных производственных и управленческих подразделений предприятия, так как:</p> <p>a) требует затрат, не приносящих сиюминутных доходов</p> <p>b) может привести к омертвлению части капитала</p> <p>c) все вышеперечисленное</p> <p>На основе способности критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий выбрать верные ответы.</p> <p>Участие всех подразделений компании в процессе выявления и оценки рисков по направлениям деятельности подразумевает принцип:</p> <p>a) системности</p> <p>b) комплексности</p> <p>c) интегрированности</p> <p>d) непрерывности</p> <p>8. Наиболее оптимальным и целесообразным пассивное управление рисками является на стадии:</p> <p>a) когда ресурсы имеются в достаточном количестве, есть в запасе, отвечают необходимым требованиям</p> <p>b) когда ресурсы заканчиваются и их запас исчерпан</p> <p>На основе способности критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий выбрать верные ответы.</p> <p>Концепция приемлемого риска предполагает:</p> <p>a) полностью избавить фирму от возможных</p>	
--	--	--

	<p>непредвиденных ситуаций</p> <p>b) сделать бизнес абсолютно безопасным</p> <p>c) снизить риск до уровня, когда он перестает быть угрожающим</p>	
5	<p>На основе типовых методик и действующей нормативно-правовой выбрать верные ответы. Основной целью этапа анализа альтернативных методов управления риском является:</p> <p>a) формирование у лиц, принимающих решения, целостной картины рисков</p> <p>b) исследование инструментов, с помощью которых можно препятствовать реализации риска и воздействию его негативных последствий</p> <p>c) обеспечение гибкости</p> <p>На основе типовых методик и действующей нормативно-правовой выбрать верные ответы. Формирование политики фирмы в области борьбы с риском и неопределенностью осуществляется на этапе:</p> <p>a) анализ альтернативных методов управления риском</p> <p>b) выбор методов управления риском</p> <p>c) исполнение выбранного метода управления риском</p> <p>На основе типовых методик и действующей нормативно-правовой выбрать верные ответы. Если $Q1(r)$ — приведенные расходы на снижение воздействия риска r, $Q2(r)$ — прямой ущерб, возникающий в результате воздействия риска r и $Q1(r) < Q2(r)$, то уровень риска (r):</p> <p>a) ниже приемлемого уровня</p> <p>b) выше приемлемого уровня</p> <p>c) равен приемлемому уровню</p>	ПК-2
6	<p>На основе способности к самоорганизации и самообразованию решите задачу: Определите, какой из видов деятельности является более рискованным, если известны данные о рентабельности каждого вида деятельности за ряд лет</p>	ОК-7

	(в таблице)	
7	<p>На основе способности находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность выполните задания:</p> <p>Задание 1. Классифицируйте риск потери платежеспособности согласно общей классификации рисков.</p> <p>Задание 2. Решите задачу: Определите размер ожидаемого рискового ущерба по причине вероятного отклонения прибыли предприятия в г. Известны данные по фактической прибыли предприятия с ... по (см. табл.). Уровень приемлемого риска составляет 0,25% от ожидаемой прибыли. Теоретическая вероятность риска примерно равна частоте прогнозируемого размера прибыли.</p>	ОПК-4
8	<p>На основе способности собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов выполните задания:</p> <p>Задание 1. Перечислите возможные факторы и причины риска банкротства предприятия.</p> <p>Задание 2. Решите задачу: На основе данных, представленных в таблице, дайте оценку вероятности наступления риска неоплаты или несвоевременной оплаты услуг фирмы с помощью контент-анализа:</p>	ПК-1
9	<p>На основе способности критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий выполните задания:</p> <p>Задание 1. Опишите риск снижения спроса на продукцию предприятия структурно последующим характеристикам: опасность, подверженность риску, уязвимость (чувствительность к риску) и степень взаимодействия рисков.</p> <p>Задание 2. Решите задачу:</p>	ПК-11

	<p>В соответствии с разработанным биз-нес-планом инвестиционного проекта размер плановой прибыли по проекту составляет 5400 тыс. долл. Постройте карту рисков проекта на основании следующих параметров:</p> <p>1) вероятность воздействия рисков;</p> <p>2) доля величины потерь, возникающих в результате воздействия риска по отношению к плановой прибыли организации по проекту.</p> <p>Исходные данные для построения карты рисков представлены в табл</p>	
10	<p>На основе способности на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов выполните задания:</p> <p>Задание 1. Классифицируйте риск разрушения складского помещения фирмы в результате стихийного бедствия согласно общей классификации рисков.</p> <p>Задание 2. Решите задачу:</p> <p>Используя экономико-статистический метод, определите планируемый размер прибыли предприятия в 2010 г. Исходные данные представлены в таблице.</p>	ПК-2

4. Файл и/или БТЗ с полным комплектом оценочных материалов прилагается.