**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования**

«ТОМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ СИСТЕМ
УПРАВЛЕНИЯ И РАДИОЭЛЕКТРОНИКИ»
(ТУСУР)

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе
_____ П. В. Сенченко
«___» _____ 20__ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

# Управление рисками

Уровень образования: **высшее образование - бакалавриат**
Направление подготовки / специальность: **38.03.03 Управление персоналом**
Направленность (профиль) / специализация: **Управление персоналом организации**
Форма обучения: **заочная**
Факультет: **ЗиВФ, Заочный и вечерний факультет**
Кафедра: **менеджмента, Кафедра менеджмента**
Курс: **5**
Семестр: **9, 10**
Учебный план набора 2018 года

Распределение рабочего времени

| № | Виды учебной деятельности | 9 семестр | 10 семестр | Всего | Единицы |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | Лекции | 4 | 8 | 12 | часов |
| 2 | Практические занятия | 4 | 8 | 12 | часов |
| 3 | Всего аудиторных занятий | 8 | 16 | 24 | часов |
| 4 | Самостоятельная работа | 28 | 16 | 44 | часов |
| 5 | Всего (без экзамена) | 36 | 32 | 68 | часов |
| 6 | Подготовка и сдача зачета | 0 | 4 | 4 | часов |
| 7 | Общая трудоемкость | 36 | 36 | 72 | часов |
| | | | | 2.0 | З.Е. |

Контрольные работы: 10 семестр - 1
Зачёт: 10 семестр

Томск

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Шелупанов А.А.
Должность: Ректор
Дата подписания: 20.12.2017
Уникальный программный ключ:
c53e145e-8b20-45aa-9347-a5e4dbb90e8d

Согласована на портале № 48820

Рассмотрена и одобрена на заседании кафедры
протокол № 2 от «18» 2 2020 г.

# ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЯ

Рабочая программа дисциплины составлена с учетом требований федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки (специальности) 38.03.03 Управление персоналом, утвержденного 14.12.2015 года, рассмотрена и одобрена на заседании кафедры менеджмента «___» _____ 20__ года, протокол №_____.

Разработчики:

старший преподаватель Кафедры менеджмента (менеджмента) _____ Т. В. Архипова

профессор Кафедры менеджмента (менеджмента) _____ М. А. Афонасова

Заведующий обеспечивающей каф. менеджмента _____ М. А. Афонасова

Рабочая программа дисциплины согласована с факультетом и выпускающей кафедрой:

Декан ЗиВФ _____ И. В. Осипов

Заведующий выпускающей каф. менеджмента _____ М. А. Афонасова

Эксперты:

Доцент кафедры менеджмента (менеджмента) _____ Т. А. Рябчикова

Доцент кафедры менеджмента (менеджмента) _____ Т. Д. Санникова

Согласована на портале № 48820

## 1. Цели и задачи дисциплины

### 1.1. Цели дисциплины

формирование у студентов знаний о методах оценки, анализа и управления рисками, а также умений и навыков использования этих инструментов в процессе управления организацией.

### 1.2. Задачи дисциплины

– сформировать знания у обучающихся об основных элементах системы управления финансовыми рисками организации, приемах управления предпринимательскими и финансовыми рисками предприятия; методах и моделях, используемых в анализе, оптимизации финансовых операций с учетом факторов риска;

– сформировать навыки использования в практической деятельности современных специальных экономико-математических инструментов анализа и оценки риска;

– сформировать навыки выработки решения в условиях риска и неопределенности и решения задач по управлению финансовыми рисками организации.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Управление рисками» (Б1.В.ОД.10) относится к блоку 1 (вариативная часть).

Предшествующими дисциплинами, формирующими начальные знания, являются: Экономический анализ.

Последующими дисциплинами являются: Бизнес-планирование.

## 3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– ОПК-5 способностью анализировать результаты исследований в контексте целей и задач своей организации;

– ПК-30 знанием основ возникновения, профилактики и разрешения трудовых споров и конфликтов в коллективе, владением навыками диагностики и управления конфликтами и стрессами в организации и умение применять их на практике;

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

– **знать** содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методологию процесса управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками; основы основы возникновения, профилактики и разрешения трудовых споров и конфликтов в коллективе.

– **уметь** применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками; классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления; проводить выбор между способами передачи рисков, осуществлять соответствующие расчеты к ним; оценивать результативность принятых управленческих решений; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач анализа и оценки рисков; использовать математические и статистические методы расчета уровня рисков; определять привлекательность инвестиционного портфеля; пользоваться инструментами риск-менеджмента; пользоваться навыками стратегического анализа, разработки и осуществления стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности; анализировать результаты исследований в контексте целей и задач своей организации.

– **владеть** методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения поручений; владением навыками диагностики и управления конфликтами и стрессами в организации и умение применять их на практике.

## 4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2.0 зачетных единицы и представлена в таблице 4.1.

Согласована на портале № 48820

Таблица 4.1 – Трудоемкость дисциплины

| Виды учебной деятельности | Всего часов | Семестры | |
|---|---|---|---|
| | | 9 семестр | 10 семестр |
| Аудиторные занятия (всего) | 24 | 8 | 16 |
| Лекции | 12 | 4 | 8 |
| Практические занятия | 12 | 4 | 8 |
| Самостоятельная работа (всего) | 44 | 28 | 16 |
| Проработка лекционного материала | 12 | 10 | 2 |
| Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса | 12 | 6 | 6 |
| Подготовка к практическим занятиям, семинарам | 14 | 12 | 2 |
| Выполнение контрольных работ | 6 | 0 | 6 |
| Всего (без экзамена) | 68 | 36 | 32 |
| Подготовка и сдача зачета | 4 | 0 | 4 |
| Общая трудоемкость, ч | 72 | 36 | 36 |
| Зачетные Единицы | 2.0 | | |

## 5. Содержание дисциплины

### 5.1. Разделы дисциплины и виды занятий

Разделы дисциплины и виды занятий приведены в таблице 5.1.

Таблица 5.1 – Разделы дисциплины и виды занятий

| Названия разделов дисциплины | Лек., ч | Прак. зан., ч | Сам. раб., ч | Всего часов (без экзамена) | Формируемые компетенции |
|---|---|---|---|---|---|
| 9 семестр | | | | | |
| 1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов | 4 | 4 | 28 | 36 | ОПК-5, ПК-30 |
| Итого за семестр | 4 | 4 | 28 | 36 | |
| 10 семестр | | | | | |
| 2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента | 8 | 8 | 16 | 32 | ОПК-5, ПК-30 |
| Итого за семестр | 8 | 8 | 16 | 32 | |
| Итого | 12 | 12 | 44 | 68 | |

### 5.2. Содержание разделов дисциплины (по лекциям)

Содержание разделов дисциплин (по лекциям) приведено в таблице 5.2.

Таблица 5.2 – Содержание разделов дисциплин (по лекциям)

| Названия разделов | Содержание разделов дисциплины (по лекциям) | Трудоемкость, ч | Формируемые компетенции |
|---|---|---|---|
| 9 семестр | | | |
| 1 Теоретико- | Понятие и сущность риска. Определение, | 4 | ОПК-5, ПК-30 |

Согласована на портале № 48820

| | | | |
|---|---|---|---|
| методологические основы системы управления рисками проектов | функции, организация и правила управление рисками.Информационное обеспечение управления рисками.Классификация рисков.Анализ и оценка степени риска. | | |
| | Итого | 4 | |
| Итого за семестр | | 4 | |
| 10 семестр | | | |
| 2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента | Управление рисками, возникающими при инвестировании. Риск-менеджмент. Хеджирование рисков. Анализ риска в инвестиционной программе. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Рациональный выбор инвестиционного портфеля. | 8 | ОПК-5, ПК-30 |
| | Итого | 8 | |
| Итого за семестр | | 8 | |
| Итого | | 12 | |

### 5.3. Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами

Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами представлены в таблице 5.3.

Таблица 5.3 – Разделы дисциплины и междисциплинарные связи

| Наименование дисциплин | № разделов данной дисциплины, для которых необходимо изучение обеспечивающих и обеспечиваемых дисциплин | |
|---|---|---|
| | 1 | 2 |
| Предшествующие дисциплины | | |
| 1 Экономический анализ | + | + |
| Последующие дисциплины | | |
| 1 Бизнес-планирование | + | + |

### 5.4. Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий представлено в таблице 5.4.

Таблица 5.4 – Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

| Компетенции | Виды занятий | | | Формы контроля |
|---|---|---|---|---|
| | Лек. | Прак. зан. | Сам. раб. | |
| ОПК-5 | + | + | + | Контрольная работа, Конспект самоподготовки, Опрос на занятиях, Зачёт, Тест |
| ПК-30 | + | + | + | Контрольная работа, Конспект самоподготовки, Опрос на занятиях, Зачёт, Тест |

Согласована на портале № 48820

## 6. Интерактивные методы и формы организации обучения

Не предусмотрено РУП.

## 7. Лабораторные работы

Не предусмотрено РУП.

## 8. Практические занятия (семинары)

Наименование практических занятий (семинаров) приведено в таблице 8.1.

Таблица 8.1 – Наименование практических занятий (семинаров)

| Названия разделов | Наименование практических занятий (семинаров) | Трудоемкость, ч | Формируемые компетенции |
|---|---|---|---|
| 9 семестр | | | |
| 1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов | Оценка риска проекта на основе анализа безубыточности.Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределённости и риска минимаксными методами. | 4 | ОПК-5, ПК-30 |
| | Итого | 4 | |
| Итого за семестр | | 4 | |
| 10 семестр | | | |
| 2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента | Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов. Страхование как метод снижения рисков. Хеджирование как метод снижения риска. | 8 | ОПК-5, ПК-30 |
| | Итого | 8 | |
| Итого за семестр | | 8 | |
| Итого | | 12 | |

## 9. Самостоятельная работа

Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции представлены в таблице 9.1.

Таблица 9.1 – Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции

| Названия разделов | Виды самостоятельной работы | Трудоемкость, ч | Формируемые компетенции | Формы контроля |
|---|---|---|---|---|
| 9 семестр | | | | |
| 1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов | Подготовка к практическим занятиям, семинарам | 12 | ОПК-5, ПК-30 | Конспект самоподготовки, Опрос на занятиях, Тест |
| | Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса | 6 | | |
| | Проработка лекционного материала | 10 | | |
| | Итого | 28 | | |
| Итого за семестр | | 28 | | |
| 10 семестр | | | | |
| 2 Модели и методы | Выполнение контроль- | 6 | ОПК-5, ПК-30 | Зачёт, Конспект |

Согласована на портале № 48820

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента | ных работ | | | самоподготовки, Контрольная работа, Опрос на занятиях, Тест |
| | Подготовка к практическим занятиям, семинарам | 2 | | |
| | Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса | 6 | | |
| | Проработка лекционного материала | 2 | | |
| | Итого | 16 | | |
| Итого за семестр | | 16 | | |
| | Подготовка и сдача зачета | 4 | | Зачёт |
| Итого | | 48 | | |

## 10. Курсовой проект / курсовая работа

Не предусмотрено РУП.

## 11. Рейтинговая система для оценки успеваемости обучающихся

Рейтинговая система не используется.

## 12. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### 12.1. Основная литература

1. Управление рисками проектов [Электронный ресурс]: Учебное пособие / Кулешова Е. В. - 2015. 188 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4956 (дата обращения: 24.03.2020).

2. Воронцовский, А. В. Управление рисками [Электронный ресурс] [Электронный ресурс]: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. — М.: Издательство Юрайт, 2017. — 414 с. — Режим доступа: https://biblio-online.ru/book/27AFED57-ABAE-404E-9BD5-7AC50A910E5E/upravlenie-riskami (дата обращения: 24.03.2020).

### 12.2. Дополнительная литература

1. Анализ и управление рисками организации : учебное пособие для вузов / Н. А. Рыхтикова. - М. : Форум, 2009. - 239 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)

2. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе [Электронный ресурс]: учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 381 с. — Режим доступа: https://biblio-online.ru/bcode/450126 (дата обращения: 24.03.2020).

### 12.3. Учебно-методические пособия

#### 12.3.1. Обязательные учебно-методические пособия

1. Управление рисками [Электронный ресурс]: Методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе / О. Н. Петухов - 2018. 10 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/7349 (дата обращения: 24.03.2020).

#### 12.3.2. Учебно-методические пособия для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Учебно-методические материалы для самостоятельной и аудиторной работы обучающихся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации.

**Для лиц с нарушениями зрения:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

**Для лиц с нарушениями слуха:**

Согласована на портале № 48820

– в форме электронного документа;
– в печатной форме.

**Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:**
– в форме электронного документа;
– в печатной форме.

### 12.4. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. При изучении дисциплины рекомендуется обращаться к базам данных, информационно-справочным и поисковым системам, к которым у ТУСУРа открыт доступ: https://lib.tusur.ru/ru/resursy/bazy-dannyh

## 13. Материально-техническое обеспечение дисциплины и требуемое программное обеспечение

### 13.1. Общие требования к материально-техническому и программному обеспечению дисциплины

#### 13.1.1. Материально-техническое и программное обеспечение для лекционных занятий

Для проведения занятий лекционного типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации используется учебная аудитория с количеством посадочных мест не менее 22-24, оборудованная доской и стандартной учебной мебелью. Имеются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации по лекционным разделам дисциплины.

#### 13.1.2. Материально-техническое и программное обеспечение для практических занятий

Вычислительная лаборатория / Компьютерный класс

учебная аудитория для проведения занятий практического типа, учебная аудитория для проведения занятий лабораторного типа

634045, Томская область, г. Томск, ул. Красноармейская, д. 146, 505 ауд.

Описание имеющегося оборудования:
- ПЭВМ DX6100M (9 шт.);
- ПЭВМ INTEL CORE 2 DUO (6 шт.);
- Магнитно-маркерная доска;
- Комплект специализированной учебной мебели;
- Рабочее место преподавателя.

Программное обеспечение:
– 7-Zip
– Google Chrome
– Microsoft Windows 7 Pro
– Mozilla Firefox
– OpenOffice
– Консультант Плюс

#### 13.1.3. Материально-техническое и программное обеспечение для самостоятельной работы

Для самостоятельной работы используются учебные аудитории (компьютерные классы), расположенные по адресам:
- 634050, Томская область, г. Томск, Ленина проспект, д. 40, 233 ауд.;
- 634045, Томская область, г. Томск, ул. Красноармейская, д. 146, 201 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 47, 126 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 74, 207 ауд.

Состав оборудования:
- учебная мебель;
- компьютеры класса не ниже ПЭВМ INTEL Celeron D336 2.8ГГц. - 5 шт.;
- компьютеры подключены к сети «Интернет» и обеспечивают доступ в электронную ин-

Согласована на портале № 48820

формационно-образовательную среду университета.

Перечень программного обеспечения:
- Microsoft Windows;
- OpenOffice;
- Kaspersky Endpoint Security 10 для Windows;
- 7-Zip;
- Google Chrome.

### 13.2. Материально-техническое обеспечение дисциплины для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Освоение дисциплины лицами с ограниченными возможностями здоровья и инвалидами осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения.

При занятиях с обучающимися **с нарушениями слуха** предусмотрено использование звукоусиливающей аппаратуры, мультимедийных средств и других технических средств приема/передачи учебной информации в доступных формах, мобильной системы преподавания для обучающихся с инвалидностью, портативной индукционной системы. Учебная аудитория, в которой занимаются обучающиеся с нарушением слуха, оборудована компьютерной техникой, аудиотехникой, видеотехникой, электронной доской, мультимедийной системой.

При занятиях с обучающимися **с нарушениями зрениями** предусмотрено использование в лекционных и учебных аудиториях возможности просмотра удаленных объектов (например, текста на доске или слайда на экране) при помощи видеоувеличителей для комфортного просмотра.

При занятиях с обучающимися **с нарушениями опорно-двигательного аппарата** используются альтернативные устройства ввода информации и другие технические средства приема/передачи учебной информации в доступных формах, мобильной системы обучения для людей с инвалидностью.

## 14. Оценочные материалы и методические рекомендации по организации изучения дисциплины

### 14.1. Содержание оценочных материалов и методические рекомендации

Для оценки степени сформированности и уровня освоения закрепленных за дисциплиной компетенций используются оценочные материалы в составе:

#### 14.1.1. Тестовые задания

1. Риск – это...

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

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

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

г) все выше перечисленное.

2. Отметьте потери, которые можно отнести к трудовым:

а) потери рабочего времени;

б) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию;

в) уплата дополнительных налогов;

г) невыполнение сроков сдачи объекта.

3. Анализ риска – это...

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

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

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

Согласована на портале № 48820

г) нет верного ответа.

4. Идентификация риска – это…

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

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

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

г) нет верного ответа.

5. Последствия риска могут быть:

а) скорее положительными;

б) как положительными, так и отрицательными;

в) только отрицательными;

г) скорее отрицательными.

6. Систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия называется:

а) идентификацией рисков;

б) анализом рисков;

в) классификацией рисков;

г) планированием рисков.

7. Какой из перечисленных методов оценки риска основан на расчетах и анализе статистических показателей?

а) вероятностный метод;

б) построение дерева решений;

в) метод сценариев;

г) анализ чувствительности;

д) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;

е) имитационное моделирование.

8. Какой из перечисленных методов оценки риска дает представление о наиболее критических факторах инвестиционного проекта?

а) построение дерева решений;

б) метод сценариев;

в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;

г) анализ чувствительности;

д) имитационное моделирование.

9. Какой из перечисленных методов оценки риска реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков?

а) построение дерева решений;

б) метод сценариев;

в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;

г) анализ чувствительности;

д) вероятностный метод;

е) имитационное моделирование.

10. Какой из перечисленных методов оценки риска используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий?

а) вероятностный метод;

б) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;

в) построение дерева решений;

г) метод сценариев.

11. Что является субъектом управления в риск-менеджменте?

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

Согласована на портале № 48820

б) все варианты верны;

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

г) персонал организации.

12. Что является объектом управления в риск-менеджменте?

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

б) все варианты верны;

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

г) оборудование в организации.

13. Какой из перечисленных методов оценки риска представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты?

а) имитационное моделирование;

б) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;

в) анализ чувствительности;

г) построение дерева решений.

15. К какому виду риска относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент:

а) экономический;

б) предпринимательский;

в) политический;

г) технический.

16. Какой из видов производственного риска приводит к увеличению затрат на ремонт и модернизацию оборудования?

а) выявление новых технологий в отрасли;

б) использование устаревшего оборудования;

в) нестабильность качества товаров и услуг;

г) все варианты верны.

17. Величиной кредитного риска является:

а) сумма кредита с учетом процентов;

б) сумма процентов по кредиту;

в) сумма кредита по договору;

г) все варианты верны.

18. Коэффициент автономности показывает:

а) отношение оборотных средств к собственному капиталу компании;

б) отношение постоянных затрат к валовым затратам;

в) отношение заемных средств к собственному капиталу компании;

г) нет верного ответа.

19. Основными признаками инвестиционной деятельности являются:

а) неопределенность результатов;

б) необратимость;

в) ожидание увеличения исходного уровня благосостояния;

г) все выше перечисленное.

20. Волатильность - это:

а) изменчивость рыночного спроса;

б) постоянство рыночного спроса;

в) мера риска использования финансового инструмента за заданный промежуток времени;

г) все перечисленное.

### 14.1.2. Зачёт

1. Понятие риска и неопределенности.

2. Общая характеристика хозяйственных рисков, их классификация.

3. Концепции управления рисками.

Согласована на портале № 48820

4. Стратегия управления рисками.
5. Сущность риск-менеджмента, его цели и задачи.
6. Объекты и субъекты риск-менеджмента.
8. Содержание политики управления финансовыми рисками.
7. Принципы риск-менеджмента.
9. Методы управления финансовыми рисками.
10. Методы оценки финансовых рисков.
11. Показатели оценки риска.
12. Качественный анализ рисков.
13. Количественный анализ рисков.
14. Экономико-статистические методы оценки риска.
15. Оценка риска структуры активов по степени их ликвидности.
16. Оценка риска банкротства предприятия по российским моделям.
17. Оценка риска банкротства по международным моделям.
18. Виды рисков инвестиционных проектов.
19. Методы оценки инвестиционных рисков.
20. Риск инвестирования в отдельный финансовый актив.
21. Риск инвестиционного портфеля.
22. Способы снижения риска инвестиционного портфеля.
23. Анализ безубыточности и производственный риск компании.
24. Взаимосвязь показателя WACC и риска компании.
25. Особенности банковских рисков.
26. Методы управления рисками на предприятии.
27. Риски, возникающие при проведении биржевых операций на товарном и фондовом рынках.
28. Специфика управления рисками в страховых компаниях.
29. Хеджирование как метод управления рисками. Инструменты хеджирования.
30. Форвардные, фьючерсные и опционные контракты как инструменты управления финансовыми рисками.
31. Диверсификация как метод управления финансовыми рисками.
32. Страхование риска.
33. Концепция рисковой стоимости (VaR).

### 14.1.3. Вопросы на самоподготовку

1. Взаимосвязь показателя WACC и риска компании.
2. Особенности банковских рисков.
3. Риски, возникающие при проведении биржевых операций на товарном и фондовом рынках.
4. Специфика управления рисками в страховых компаниях.
5. Форвардные, фьючерсные и опционные контракты как инструменты управления финансовыми рисками.
6. Диверсификация как метод управления финансовыми рисками.
7. Концепция рисковой стоимости (VaR).

### 14.1.4. Темы опросов на занятиях

Понятие и сущность риска. Определение, функции, организация и правила управление рисками. Информационное обеспечение управления рисками. Классификация рисков. Анализ и оценка степени риска.

Управление рисками, возникающими при инвестировании. Риск-менеджмент. Хеджирование рисков. Анализ риска в инвестиционной программе. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Рациональный выбор инвестиционного портфеля.

### 14.1.5. Темы контрольных работ

1. Понятие неопределенности и риска.
2. Классификация предпринимательских рисков.
3. Рыночные риски.

Согласована на портале № 48820

4. Кредитные риски.
5. Риски ликвидности.
6. Риски инвестиционных проектов.
7. Инфляционные риски.
8. Операционные риски.
9. Коммерческие риски.
10. Риски инвестиционных проектов.
11. Качественные методы анализа рисков.
12. Количественные методы управления рисками.
13. Метод деревьев решений в анализе рисков.
14. Использование метода сценариев при анализе рисков.
15. Анализ чувствительности при оценке риска.
16. Применение метода Монте-Карло (имитационного моделирования) при оценке рисков.
17. Применение методов теории игр при принятии решений в условиях риска.
18. Использование методов теории вероятностей при принятии решений в условиях риска.
19. Управление рисками.
20. Страхование рисков.
21. Хеджирование рисков.
22. Диверсификация как метод управления рисками.
23. Лимитирование как способ снижения рисков.
24. Применение резервирования при управлении рисками.
25. Понятие неопределенности и риска.
26. Классификация предпринимательских рисков.
27. Рыночные риски.
28. Кредитные риски.
29. Риски ликвидности.
30. Риски инвестиционных проектов.
31. Инфляционные риски.
32. Операционные риски.
33. Коммерческие риски.
34. Риски инвестиционных проектов.
35. Качественные методы анализа рисков.
36. Количественные методы управления рисками.
37. Метод деревьев решений в анализе рисков.
38. Использование метода сценариев при анализе рисков.
39. Анализ чувствительности при оценке риска.
40. Применение метода Монте-Карло (имитационного моделирования) при оценке рисков.

### 14.2. Требования к оценочным материалам для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предусмотрены дополнительные оценочные материалы, перечень которых указан в таблице 14.

Таблица 14 – Дополнительные материалы оценивания для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

| Категории обучающихся | Виды дополнительных оценочных материалов | Формы контроля и оценки результатов обучения |
|---|---|---|
| С нарушениями слуха | Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы | Преимущественно письменная проверка |
| С нарушениями зрения | Собеседование по вопросам к зачету, опрос по терминам | Преимущественно устная проверка (индивидуально) |
| С нарушениями опорно- | Решение дистанционных тестов, контрольные работы, письменные | Преимущественно дистанционными методами |

Согласована на портале № 48820

| | | |
|---|---|---|
| двигательного аппарата | самостоятельные работы, вопросы к зачету | |
| С ограничениями по общемедицинским показаниям | Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы, устные ответы | Преимущественно проверка методами исходя из состояния обучающегося на момент проверки |

### 14.3. Методические рекомендации по оценочным материалам для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предусматривается доступная форма предоставления заданий оценочных средств, а именно:

- в печатной форме;
- в печатной форме с увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа;
- методом чтения ассистентом задания вслух;
- предоставление задания с использованием сурдоперевода.

Лицам с ограниченными возможностями здоровья и инвалидам увеличивается время на подготовку ответов на контрольные вопросы. Для таких обучающихся предусматривается доступная форма предоставления ответов на задания, а именно:

- письменно на бумаге;
- набор ответов на компьютере;
- набор ответов с использованием услуг ассистента;
- представление ответов устно.

Процедура оценивания результатов обучения лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

**Для лиц с нарушениями зрения:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

**Для лиц с нарушениями слуха:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

**Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

При необходимости для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения может проводиться в несколько этапов.

Согласована на портале № 48820