

**ГОУ ВПО «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ
КАФЕДРА ЭКОНОМИКИ ПРЕДПРИЯТИЯ**

УТВЕРЖДАЮ:

Проректор по научно-методической
и учебной работе

Е.И.Скафа

«17» апреля 2019 г.



**Рабочая программа учебной дисциплины
«УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ»**

| | |
|---|--|
| Укрупненная группа направлений подготовки | <i>38.00.00 Экономика и управление</i> |
| Направление подготовки | <i>38.04.01 Экономика</i> |
| Магистерская программа | <i>Экономика предприятий</i> |
| Программа подготовки | <i>Академическая магистратура</i> |
| Квалификация | <i>Магистр</i> |
| Форма обучения | <i>Очная, заочная</i> |

Донецк 2019

УТВЕРЖДАЮ:

И. о. декана экономического факультета
Ю. Н. Полшков

11.04.2019 г. _____



Рабочая программа учебной дисциплины «Управление рисками» составлена с учетом Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (уровень магистратуры), утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 30 марта 2015 г. № 321 (с изменениями и дополнениями от 13 июля 2017 г.)

Программа составлена на основе ГОС ВПО по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, утвержденного приказом Министерства образования и науки ДНР от 13 июля 2016 г. № 757, зарегистрированного в Министерстве юстиции ДНР от 8 августа 2016 г. № 1460; «Порядка организации учебного процесса в образовательных организациях высшего профессионального образования Донецкой Народной Республики», утвержденного приказом Министерства образования и науки ДНР № 1171 от 11.11.2017 г.; учебного плана по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, магистерской программы: Экономика предприятий, утвержденного Ученым советом университета от 02.04.2019 г., протокол № 3.

Разработчик:

Кандидат экономических наук, доцент,
доцент кафедры экономики предприятия



А.Л.Тофан

Программа учебной дисциплины утверждена на заседании кафедры экономики предприятия

Протокол № 8 от «08» апреля 2019 г.

Зав. кафедрой



В.В.Краснова

Программа учебной дисциплины одобрена учебно-методической комиссией экономического факультета

Протокол № 4 от «09» апреля 2019 г.
Председатель УМК



Е.Н.Стрелина

1. ОБЛАСТЬ ПРИМЕНЕНИЯ И МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В УЧЕБНОМ ПРОЦЕССЕ

Учебная дисциплина «Управление проектами» относится к циклу вариативной части образовательной программы. Для изучения данной учебной дисциплины необходимы знания, умения и навыки, *формируемые предшествующими дисциплинами* – экономика фирмы, макроэкономика (продвинутый уровень), микроэкономика (продвинутый уровень), управление экономической безопасностью, управление персоналом, международный менеджмент, управление потенциалом предприятия, управление конкурентоспособностью, и *сопутствующими* – управление проектами, финансовый менеджмент, экономическая диагностика, стратегическое управление предприятием, управление интеллектуальной собственностью. Знания, умения и навыки, полученные в ходе изучения дисциплины «Управление рисками», используются при написании выпускной квалификационной работы.

Структура дисциплины

| | | |
|--|--|---------|
| Направление подготовки | 38.04.01 Экономика | |
| Магистерская программа | Экономика предприятий | |
| Программа подготовки | Академическая магистратура | |
| Квалификация | Магистр | |
| Количество содержательных модулей (тем) | 2 (12) | |
| Дисциплина базовой / вариативной части образовательной программы | Вариативная часть | |
| Формы контроля | 1 модульный контроль, экзамен в 3-м семестре | |
| Показатели трудоемкости | Форма обучения | |
| | очная | заочная |
| Количество зачетных единиц | 2 | 2 |
| Год подготовки | 2 | 2 |
| Семестр | 2 | - |
| Количество часов | 72 | 72 |
| - лекционных | 24 | 2 |
| - практических | 12 | 4 |
| - лабораторных | 12 | - |
| - самостоятельной работы | 48 | 66 |
| в т.ч. индивидуальное задание | - | - |
| Недельное количество часов, т.ч. | 6 | × |
| аудиторных | 2 | × |
| самостоятельной работы студента | 4 | × |

2. ОПИСАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель изучения дисциплины «Управление рисками» – формирование у студентов современного экономического мышления и системы специальных знаний в отрасли диагностики и моделирования экономических процессов в условиях риска, содействие приобретению навыков в принятии управленческих решений в ситуациях, связанных с риском на основе использования экономическо-математических, статистических методов.

Задачи – усвоение студентами теоретических основ и практических навыков методологии управления рисками, изучение специфики управления рисками в различных сферах деятельности.

Требования к результатам освоения дисциплины: процесс изучения дисциплины направлен на формирование элементов следующих компетенций в соответствии с ГОС ВО РФ по направлению подготовки 38.04.01. Экономика и основной образовательной программой высшего образования по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (магистерская программа: Экономика предприятий):

| <i>общекультурных (ОК):</i> | |
|---|--|
| ОК-1 | способностью к абстрактному мышлению, анализу, синтезу |
| ОК-2 | готовностью действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения |
| ОК-3 | готовностью к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала |
| <i>общепрофессиональных (ОПК):</i> | |
| ОПК-2 | готовностью руководить коллективом в сфере своей профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия |
| ОПК-3 | способностью принимать организационно-управленческие решения |
| <i>профессиональных (ПК):</i> | |
| <i>научно-исследовательская деятельность:</i> | |
| ПК-1 | способностью обобщать и критически оценивать результаты, полученные отечественными и зарубежными исследователями, выявлять перспективные направления, составлять программу исследований |
| ПК-2 | способностью обосновывать актуальность, теоретическую и практическую значимость избранной темы научного исследования |
| ПК-3 | способностью проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой |
| ПК-4 | способностью представлять результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи или доклада |
| <i>проектно-экономическая деятельность:</i> | |
| ПК-5 | способностью самостоятельно осуществлять подготовку заданий и разрабатывать проектные решения с учетом фактора неопределенности, разрабатывать соответствующие методические и нормативные документы, а также предложения и мероприятия по реализации разработанных проектов и программ |
| ПК-6 | способностью оценивать эффективность проектов с учетом фактора неопределенности |
| <i>аналитическая деятельность:</i> | |
| ПК-9 | способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов |
| <i>организационно-управленческая деятельность:</i> | |
| ПК-11 | способностью руководить экономическими службами и подразделениями на предприятиях и организациях различных форм собственности, в органах государственной и муниципальной власти |
| ПК-12 | способностью разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности |
| <i>педагогическая деятельность:</i> | |
| ПК-13 | способностью применять современные методы и методики преподавания экономических дисциплин в профессиональных образовательных организациях, образовательных организациях высшего образования, дополнительного профессионального образования |
| ПК-14 | способностью разрабатывать учебные планы, программы и соответствующее методическое обеспечение для преподавания экономических дисциплин в профессиональных образовательных организациях, образовательных организациях высшего образования, дополнительного профессионального образования |

В результате изучения учебной дисциплины студент должен:

знать:

- базовые понятия, основные постулаты и принципы рискологии;
- закономерности эволюции и функционирования предприятий в условиях риска;

- методы управления рисками, особенности и последствия их применения.

уметь:

- выполнять предварительный отбор и обработку данных, предназначенных для оценки, анализа и управления рисками;
- выполнять работы по учету и выявлению негативных последствий рисков;
- вырабатывать для конкретной организации рациональную систему управления рисками;
- оценивать последствия принимаемых решений при реализации программы управления рисками.

владеть

- разнообразными методами управления рисками для решения различных фундаментальных и прикладных задач;
- решения конкретных научных, организационных и управленческих вопросов при работе по управлению рисками на различных предприятиях.

3. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ И ФОРМЫ ОРГАНИЗАЦИИ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА

Дисциплина «Управление рисками» предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, практические занятия, самостоятельную работу студентов.

Материал излагается с использованием объяснительно-иллюстративных, эвристических и исследовательских методов преподавания. При проведении лекций и практических занятий используются мультимедийные презентации, документальные и анимационные видеоролики научно-познавательного характера, раздаточные материалы.

В учебном процессе широко применяются активные и интерактивные формы проведения занятий (разбор конкретных ситуаций, дискуссия, полемика), внеаудиторная самостоятельная работа, балльно-рейтинговая система оценки успеваемости, личностно-ориентированное обучение, проблемное обучение.

В учебном процессе используются интернет-ресурсы по данному курсу; рассматриваются задачи, максимально приближенные к конкретным практическим ситуациям, тесты, самостоятельная работа; контрольные работы.

Самостоятельная работа студентов предусматривает подготовку к практическим занятиям, подготовку конспектов по отдельным вопросам изучаемых тем, изучение учебной и методической литературы, аннотаций статей, подготовку и защиту результатов собственных научных исследований.

Тематический план дисциплины «Управление рисками»

| Темы | Вопросы темы |
|--|---|
| Содержательный модуль 1 | |
| <i>Теоретические основы функционирования предприятий в рискованной среде</i> | |
| Тема 1. Понятия риска и неопределенности. Классификация рисков | Риск и неопределенность – взаимосвязь и различие понятий. Функции риска в экономике. Классификация и характеристика рисков. Риски инвестиционного проекта. |
| Тема 2. Основные положения современной теории рисков | Эволюция исследования неопределенности и риска. Аксиомы теории риска. Случайность как причина риска. Концепция «риск-доходность». |
| Тема 3. Типология решений и критерии выбора в рискованных ситуациях | Характеристика отношения индивидов к риску. Индивиды, не склонные к риску или противники риска (risk-aversers); нейтральные к риску (risk-neutrals) и склонные к риску (risk-takers). Модель выбора индивида в условиях неопределенности. Функция полезности дохода |
| Тема 4. Риск и неопределенность при информатизации | Информатизация бизнеса. Специфика ИТ-отрасли. Классификация рисков в ИТ-проектах. Формулировка риска (по |

| | |
|--|---|
| бизнеса | MSF). Планирование и идентификация рисков. Процесс выявления рисков (по MSF). Количественная и качественная оценка рисков ИТ-проектов |
| Тема 5. Стандарты и методологии управления рисками | Стандарт. Методология. Классификация стандартов управления рисками. Методология PMBoK (Project Management Body of Knowledge). Риски при использовании методологий. Риски в жизненном цикле продукта. Метрики качества. Влияние изменений на риски проектов. Аудит как средство управления рисками. |
| Тема 6. Риски в аутсорсинге | Аутсорсинг. Виды аутсорсинга. Риски и выгоды от использования аутсорсинга. Методы управления рисками аутсорсинга. |
| Содержательный модуль 2 <i>Внешние предпринимательские риски и методы управления ими в системе функционирования предприятий</i> | |
| Тема 7. Управление рыночными рисками | Понятие рыночного риска. Классификация рыночных рисков. Портфельный подход к системе управления рисками. Тактический и стратегический риск-менеджмент. Измерение риска. Доходность и волатильность. Модель оценки капитальных активов (CAPM). Концепция стоимостной меры риска (VaR). |
| Тема 8. Управление кредитными рисками | Понятие кредитного риска. Классификация кредитных рисков. Финансовые институты и инструменты, подверженные кредитному риску. Показатели кредитного риска. Кредитное событие. Классический анализ кредитоспособности заемщика. Понятие кредитного рейтинга. Модели оценки кредитоспособности: Z-модель Альтмана, модель ZETA. |
| Тема 9. Методы оценки рисков | Статистические методы исследования и оценки рисков: вероятность, мат. ожидание, дисперсия, среднеквадратическое отклонение, коэффициент вариации. Закон нормального распределения вероятностей. Правило «трех сигм». Метод экспертных оценок. Метод аналогий. Ожидаемая полезность и теория риска Бернулли. Шкалы полезности. Функция полезности фон Неймана-Моргенштерна. |
| Тема 10. Управление рисками | Управление рисками в системе менеджмента предприятия. Объект и субъект управления рисками. Основные задачи при управлении рисками. Принципы и правила управления рисками. Этапы процесса управления риском: выявление (идентификация) риска, оценка риска, принятие решений, контроль риска. Информационное обеспечение процесса управления рисками. Методы управления рисками: диверсификация, страхование, хеджирование. |
| Тема 11. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска | Имитационная модель оценки риска. Анализ чувствительности результатов проекта к изменению условий его реализации. Метод корректировки на риск денежного потока инвестиционного проекта. Метод корректировки на риск коэффициента дисконтирования инвестиционного проекта. |
| Тема 12. Оценка риска и принятие решений в условиях неопределенности | Критерии оценки риска при отсутствии данных о вероятности возможных исходов. Понятие субъективной вероятности. Критерии принятия решений в условиях неопределенности: критерий крайнего пессимизма (Вальда, максимина), критерий крайнего оптимизма (максимакса), альфа-критерий Гурвица, критерий Сэвиджа (критерий отказа от минимакса), критерий Лапласа (Байесово решение). Выбор критерия в зависимости от рискованных обстоятельств |

Структура дисциплины «Управление рисками» по видам учебной деятельности

| Названия тем | Количество часов | | | | | | | |
|--|------------------|--------|--------------|-----|---------------|--------|--------------|-----|
| | Очная форма | | | | Заочная форма | | | |
| | Всего | в т.ч. | | | Всего | в т.ч. | | |
| | | Лекции | Практические | СРС | | Лекции | Практические | СРС |
| Содержательный модуль 1 | | | | | | | | |
| Теоретические основы функционирования предприятий в рискованной среде | | | | | | | | |
| Тема 1. Понятия риска и неопределенности. Классификация рисков | 3 | 0 | 1 | 2 | 3 | | | 3 |
| Тема 2. Основные положения современной теории рисков | 6 | 1 | 1 | 4 | 6 | 0,5 | | 5,5 |
| Тема 3. Типология решений и критерии выбора в рискованных ситуациях | 6 | 0 | 2 | 4 | 6 | | 1 | 5 |
| Тема 4. Риск и неопределенность при информатизации бизнеса | 7 | 1 | 2 | 4 | 7 | 0,5 | | 6,5 |
| Тема 5. Стандарты и методологии управления рисками | 7 | 2 | 1 | 4 | 7 | | | 7 |
| Тема 6. Риски в аутсорсинге | 7 | 0 | 1 | 6 | 7 | | 1 | 6 |
| Итого по содержательному модулю 1 | 36 | 4 | 8 | 24 | 36 | 1 | 2 | 33 |
| Содержательный модуль 2 | | | | | | | | |
| Внешние предпринимательские риски и методы управления ими в системе функционирования предприятий | | | | | | | | |
| Тема 7. Управление рыночными рисками | 6 | 2 | 0 | 4 | 6 | | | 6 |
| Тема 8. Управление кредитными рисками | 8 | 2 | 2 | 4 | 8 | | 1 | 7 |
| Тема 9. Методы оценки рисков | 6 | 2 | 0 | 4 | 6 | 0,5 | | 5,5 |
| Тема 10. Управление рисками | 5 | 0 | 1 | 4 | 5 | | 1 | 4 |
| Тема 11. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска | 5 | 0 | 1 | 4 | 5 | 0,5 | | 4,5 |
| Тема 12. Оценка риска и принятие решений в условиях неопределенности | 6 | 2 | 0 | 4 | 6 | | | 6 |
| Итого по содержательному модулю 2 | 36 | 8 | 4 | 24 | 36 | 1 | 2 | 33 |
| Всего | 72 | 12 | 12 | 48 | 72 | 2 | 4 | 66 |

4. КОНТРОЛЬНЫЕ ВОПРОСЫ К ЭКЗАМЕНУ И МОДУЛЬНОЙ КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЕ

Содержательный модуль 1

Теоретические основы функционирования предприятий в рискованной среде

1. Риск и неопределенность – взаимосвязь и различие понятий. Функции риска в экономике.
2. Классификация и характеристика рисков. Риски инвестиционного проекта.
3. Эволюция исследования неопределенности и риска. Аксиомы теории риска. Случайность как причина риска.

4. Концепция «риск-доходность». Модель CAPM.
5. Характеристика отношения индивидов к риску.
6. Индивиды, не склонные к риску или противники риска (risk-aversers); нейтральные к риску (risk-neutrals) и склонные к риску (risk-takers).
7. Модель выбора индивида в условиях неопределенности.
8. Функция полезности дохода индивида.
9. Безрисковый эквивалент и премия за риск.
10. Индексы неприятия риска Эрроу-Пратта.
11. Статистические методы исследования и оценки рисков: вероятность, мат. ожидание, дисперсия, среднееквадратическое отклонение, коэффициент вариации. Закон нормального распределения вероятностей. Правило «трех сигм».
12. Метод экспертных оценок.
13. Метод аналогий.
14. Ожидаемая полезность и теория риска Бернулли. Шкалы полезности. Функция полезности фон Неймана-Моргенштерна.
15. Управление рисками в системе менеджмента предприятия. Объект и субъект управления рисками. Основные задачи при управлении рисками. Принципы и правила управления рисками.
16. Этапы процесса управления риском: выявление (идентификация) риска, оценка риска, принятие решений, контроль риска. Информационное обеспечение процесса управления рисками.
17. Методы анализа риска: феноменологический, детерминистский, вероятностный, экспертный.
18. Методы оценки риска: статистический, вероятностно-статистический, теоретико-вероятностный, эвристический.
19. Методы прогноза риска. Показатели достоверности прогноза.
20. Организация управления рисками. Структура, уровни и механизмы управления рисками.
21. Процесс управления риском.
22. Принципы принятия решений об управлении рисками.
23. Классическая схема принятия решения.
24. Методы принятия рациональных решений.
25. Методы оптимизации решений по управлению рисками.
26. Теоретические основания и этапы эволюции риск-менеджмента.
27. Парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия.
28. «Колесо риск-менеджмента».
29. Понятие и виды стресс-тестирования. Требования регулирующих органов к проведению стресс-тестирования.
30. Информатизация бизнеса. Специфика ИТ-отрасли.
31. Классификация рисков в проектах. Формулировка риска (по MSF). Планирование и идентификация рисков.
32. Процесс выявления рисков (по MSF).
33. . Классификация стандартов управления рисками.
34. Методология PMBoK (Project Management Body of Knowledge).

Содержательный модуль 2

Внешние предпринимательские риски и методы управления ими в системе функционирования предприятий

1. Методы управления рисками: диверсификация, страхование, хеджирование.
2. Имитационная модель оценки риска. Анализ чувствительности результатов проекта к изменению условий его реализации.

3. Метод корректировки на риск денежного потока инвестиционного проекта.
4. Метод корректировки на риск коэффициента дисконтирования инвестиционного проекта.
5. Критерии оценки риска при отсутствии данных о вероятности возможных исходов. Понятие субъективной вероятности.
6. Критерии принятия решений в условиях неопределенности: критерий крайнего пессимизма (Вальда, максимина), критерий крайнего оптимизма (максимакса), альфа-критерий Гурвица, критерий Сэвиджа (критерий отказа от минимакса), критерий Лапласа (Байесово решение).
7. Выбор критерия в зависимости от рискованных обстоятельств.
8. Портфельный подход к системе управления рисками.
9. Тактический и стратегический риск-менеджмент.
10. Модель оценки капитальных активов (CAPM).
12. Концепция стоимостной меры риска (VaR).
12. Современные проблемы риск-менеджмента.
13. Понятие кредитного риска. Классификация кредитных рисков.
14. Финансовые институты и инструменты, подверженные кредитному риску.
15. Показатели кредитного риска. Кредитное событие.
16. Классический анализ кредитоспособности заемщика.
17. Понятие кредитного рейтинга.
18. Модели оценки кредитоспособности.

5. ОБРАЗЕЦ ЭКЗАМЕНАЦИОННОГО БИЛЕТА

ГОУ ВПО «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

Уровень высшего образования: магистратура
 Направление подготовки: 38.04.01 Экономика
 Магистерская программа: Экономика предприятий
 Форма обучения: очная, заочная
 Семестр: третий
 Учебная дисциплина: Управление рисками

Экзаменационный билет № n

Теоретическое задание. Методология PMBoK (Project Management Body of Knowledge).

Практическое задание.

1. Имеются данные о количестве и цене на уголь, необходимого зимой для отопления дома (табл). Вероятность зимы: «теплой» – 0,35, обычной – 0,5, холодной – 0,15.

| Зима | Количество угля, т | Средняя цена за 1 т в ф ст |
|----------|--------------------|----------------------------|
| «Теплая» | 4 | 7 |
| Обычная | 5 | 705 |
| Холодная | 6 | 8 |

Эти цены относятся к покупке угля зимой. Летом цена угля 6 ф ст за 1 т. У вас есть место для хранения запаса угля до 6 т., заготовленного летом. Если необходимо будет зимой докупать уголь, то он будет по зимним ценам. Предусматривается, что весь уголь, который сохранится до конца зимы, летом пропадет.

Сколько угля летом покупать зимой? Какая ожидаемая стоимость этого решения.

Утверждено на заседании кафедры «Экономика предприятия»
 Протокол № ____ от _____.20____.

Зав. кафедрой
 Экзаменатор

д.э.н., проф. Краснова В. В.
 к.э.н., доц. Тофан А. Л.

6. КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ ЭКЗАМЕНАЦИОННОГО ЗАДАНИЯ

Максимальная общая сумма баллов, которую может получить студент, успешно выполнив все виды экзаменационных заданий, составляет 40 баллов.

1. Теоретическое задание в случае полного правильного ответа – 20 баллов; есть все основные положения ответа, но допущены определенные неточности – 15-19 баллов; есть отдельные положения ответа, есть ошибки в приведенных формулах или определениях – 10-14 баллов; не более 20 % полного ответа, ошибки – 5-9 баллов; нет ответа – 0 баллов.

2. Решение задачи 1 и 2: правильное решение, сделан полный правильный вывод – 5 баллов; правильное решение, но вывод не точный (не полный) – 4 балла; правильное по смыслу решение, но есть арифметические ошибки в расчетах, вывод не точный (не полный) – 3 балла; формулы указаны правильно, но есть ошибки в ходе решения, вывода нет – 2 балла; формулы указаны, но с ошибками, расчетов нет (неправильные) – 1 балл; нет решения – 0 баллов.

3. Решение задачи 3: правильное решение, сделан полный правильный вывод – 10 баллов; правильное решение, но вывод не точный (не полный) – 8-9 баллов; правильное по смыслу решение, но есть арифметические ошибки в расчетах, вывод не точный (не полный) – 6-7 баллов; формулы указаны правильно, но есть ошибки в ходе решения, вывода нет – 4-5 баллов; формулы указаны, но с ошибками, расчетов нет (неправильные) – 2-3 балла; указаны формулы, но неправильные, расчетов нет (неправильные) – 1 балл; нет решения – 0 баллов.

7. ОБРАЗЕЦ ЗАДАНИЯ МОДУЛЬНОЙ КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

ГОУ ВПО «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

Уровень высшего образования: магистратура

Направление подготовки: 38.04.01 Экономика

Магистерская программа: Экономика предприятий

Форма обучения: очная, заочная

Семестр: третий

Учебная дисциплина: Управление рисками

Модульная контрольная работа

Вариант № п

1. *Теоретический вопрос.* Парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия

2. *Тесты (5 тестов)*

1. Главным инструментом статистического метода расчета риска является:

- а) коэффициент конкордации;
- б) коэффициент ликвидности;
- в) коэффициент вариации;
- г) коэффициент восстановления платежеспособности.

2. Какой из методов анализа целесообразно применить для выявления стратегических рисков?

- а) HAZOP;
- б) FTA;
- в) PESTLE;
- г) FMEA.

3. Какой из методов анализа целесообразно применить для выявления рисков, связанных с недостатками договорной работы?

- а) анализ сценариев;
- б) PESTLE-анализ;
- в) рассмотрение бизнес-процессов;
- г) планирование непрерывности бизнеса.

4. Что является преимуществом экспертных методов расчета рисков по сравнению со статистическими?

- а) возможность расчета финансовых рисков
 - б) привлечение квалифицированных экспертов
 - в) возможность расчета рисков опасностей
 - г) возможность оценки любого риска.
5. Какой тип рисков невозможно рассчитать статистическими методами?
- а) стратегический;
 - б) операционный;
 - в) риск прочих опасностей;
 - г) финансовый.

3. Практическое задание

Главному инженеру компании надо решить, монтировать или нет новую производственную линию, использующую новейшую технологию. если новая линия будет работать безотказно, компания получит прибыль 200 млн. грн. Если же она откажет, компания может потерять 150 млн. грн. по оценкам главного инженера, существует 60% шансов, что новая производственная линия откажет. Можно создать экспериментальную установку, а затем уже решать, монтировать или нет производственную линию. Эксперимент обойдется в 10 млн. грн. Главный инженер считает, что существует 50% шансов, что экспериментальная установка будет работать. если экспериментальная установка будет работать, то 90% шансов на то, что смонтированная производственная линия также будет работать. если же экспериментальная установка не будет работать, то только 20% шансов на то, что производственная линия заработает. следует ли строить экспериментальную установку? следует ли монтировать производственную линию? какова ожидаемая стоимостная оценка наилучшего решения?

8. КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ ЗАДАНИЯ МОДУЛЬНОГО КОНТРОЛЯ

Максимальная общая сумма баллов, которую может получить студент, успешно выполнив все виды заданий, составляет 10 баллов – по одному баллу за каждый правильный ответ на тест.

9. КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ

Организационно-учебная работа студента в аудитории оценивается на основе таких критериев как посещаемость занятий, активность во время проведения лекционных и практических занятий (вопросы лектору по теме лекционного материала, участие в обсуждении пройденного материала, решение задач и ситуаций у доски и т.п.).

Самостоятельная работа (включая выполнение СРС и ИРС) оценивается в 40 баллов. В разрезе отдельных тем оценивание осуществляется следующим образом.

Оценивание СРС и ИРС по дисциплине «Управление рисками»

| Тема | СРС | ИРС | Индивидуальное задание "Кейс" "Создание/совершенствование" |
|--|-----|-----|--|
| Содержательный модуль 1 | | | |
| Теоретические основы функционирования предприятий в рисковей среде | | | |
| Тема 1. Понятия риска и неопределенности. Классификация рисков | | 0 | |
| Тема 2. Основные положения современной теории рисков | 1 | 1 | |
| Тема 3. Типология решений и критерии выбора в рисковей ситуациях | 1 | 1 | |
| Тема 4. Риск и неопределенность при информатизации бизнеса | 2 | 1 | |
| Тема 5. Стандарты и методологии управления рисками | 1 | 1 | |
| Тема 6. Риски в аутсорсинге | | 1 | |
| Итого по содержательному модулю 1 | 5 | 5 | |
| Содержательный модуль 2 | | | |

| Внешние предпринимательские риски и методы управления ими в системе функционирования предприятий | | |
|---|-----------|-----------|
| Тема 7. Управление рыночными рисками | | 0,2 |
| Тема 8. Управление кредитными рисками | 1 | 0,2 |
| Тема 9. Методы оценки рисков | | 0,2 |
| Тема 10. Управление рисками | 2 | 0,2 |
| Тема 11. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска | 1 | 0,2 |
| Тема 12. Оценка риска и принятие решений в условиях неопределенности | 1 | 4 |
| Итого по содержательному модулю 2 | 5 | 5 |
| Итого | 10 | 10 |

10. ИНДИВИДУАЛЬНОЕ ТВОРЧЕСКОЕ ЗАДАНИЕ

На примере выбранного магистрантом проекта (перспективного, находящегося в разработке или уже реализованного на практике) разработать кейс, включающий все аспекты управления рисками на предприятии. В ходе разработки кейса целесообразно использовать отчет по рискам, разработанный студентом при изучении дисциплины «Оценка рисков» в бакалавриате.

Требования к содержанию кейса «Создание/совершенствование управления рисками на предприятии» _____».

название предприятия

Кейс по управлению проектом структурно должен включать следующие **разделы**:

1. Оценка структуры управления рисками.
2. Используемые практики управления рисками.
3. Построение реестров риска для предприятия.
4. Создание \ совершенствование СУР.

Требования относительно оформления кейса.

Проект готовится и сдается в электронном и печатном виде и должен отвечать следующим требованиям:

- **по структуре**:

- 1) Титульный лист.
- 2) Содержание.
- 3) Разделы и подразделы.
- 4) Список использованных источников (не менее 10).

- **по оформлению**:

- 1) Шрифт Times New Roman, кегель 14, интервал 1,5.
- 2) Нумерация страниц сверху, справа. Поля: левое – 3 см, верхнее и нижнее – 2 см, правое – 1,5 см.
- 3) Обязательные ссылки на использованные источники информации, включая интернет-ресурсы.
- 4) Объем работы – 20–25 страниц.

Все расчеты должны выполняться в Excel. Кейс должен быть хорошо иллюстрирован графически. В конце работы ставится подпись автора и дата.

11. КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ ИНДИВИДУАЛЬНОГО ТВОРЧЕСКОГО ЗАДАНИЯ

Защита индивидуального задания происходит поэтапно после изучения соответствующей темы в форме собеседования с преподавателем. В конце работа сдается в печатном и электронном виде.

Аналитическое обоснование кейса должно быть выполнено экономически грамотно, расчеты не должны содержать экономических и арифметических ошибок, должны быть

сделаны соответствующие выводы и обоснованные предложения относительно целесообразности предложенных мероприятий и методов по управлению проектом. Кейс оценивается максимально в 20 баллов.

20 баллов – полное соответствие разработанного кейса требованиям к содержанию и оформлению, отсутствие ошибок управленческого, экономического, математического и грамматического характера. Кейс содержит не только текстовый и расчетный материал, но и хорошо иллюстрирован графически.

10-15 баллов – кейс содержит большую часть разделов. В большей степени есть лишь описательная часть. Или если при наличии всех структурных частей обоснование и использованные методы содержат ошибки.

До 10 баллов – количество выполненных разделов менее половины. Содержание материала не раскрыто в полной мере.

12. КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ ОБЩЕЙ УСПЕВАЕМОСТИ

Общая оценка знаний студентов по дисциплине проводится по 100-балльной шкале согласно таким критериям:

| Содержательные модули | Вид работы | Баллы |
|-------------------------|--|------------|
| Содержательный модуль 1 | Организационно-учебная работа студента в аудитории | 5 |
| | Самостоятельная работа | 5 |
| | Модульная контрольная работа | 10 |
| | Итого | 5 |
| Содержательный модуль 2 | Организационно-учебная работа студента в аудитории | 25 |
| | Самостоятельная работа | 5 |
| | Итого | 10 |
| Экзамен | | 40 |
| Общий итог | | 100 |

Порядок оценивания учебных достижений обучающихся

| Оценка по шкале ECTS | Оценка по 100-балльной шкале | Оценка по государственной шкале | |
|----------------------|------------------------------|---|------------|
| | | экзамен, дифференцированный зачет | зачет |
| A | 90-100 | 5 (отлично) | зачтено |
| B | 80-89 | 4 (хорошо) | зачтено |
| C | 75-79 | 4 (хорошо) | зачтено |
| D | 70-74 | 3 (удовлетворительно) | зачтено |
| E | 60-69 | 3 (удовлетворительно) | зачтено |
| FX | 35-59 | 2 (неудовлетворительно) с возможностью повторной аттестации | не зачтено |
| F | 0-34 | 2 (неудовлетворительно) с возможностью повторной сдачи при условии обязательного набора дополнительных баллов | не зачтено |

13. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА

Для проведения лекционных и практических занятий требуется аудитория на группу, оборудованная меловой или интерактивной доской, мультимедийным проектором и экраном,

ноутбук, выход в Интернет, Wi-Fi доступ в корпусах университета, текстовые и электронные ресурсы Научной библиотеки университета и других библиотечных баз данных.

В процессе обучения студенты имеют возможность использовать учебные материалы по дисциплине «Управление рисками», размещенные на платформе Moodle Центра дистанционного образования экономического факультета ГОУ ВПО «ДонНУ». С использованием ресурсов платформы дистанционного обучения также осуществляется текущий контроль знаний студентов на основе тестирования, размещения для проверки результатов самостоятельной работы.

14. РЕКОМЕНДОВАННАЯ ЛИТЕРАТУРА

| Наименование основной литературы | | | |
|--|--|---------------------------------------|---|
| № п/п | | Кол-во экземпляров в библиотеке ДонНУ | Наличие электронной версии в ЭБС ДонНУ |
| 1 | Тофан А.Л. Управление рисками: учебное пособие для магистратуры / А.Л.Тофан. – Донецк: ГОУ ВПО «ДонНУ», 2019. – 150 с. | | + |
| 2 | Тофан А.Л. Управление рисками: учебно-методическое пособие для магистратуры /А.Л.Тофан. – Донецк: ГОУ ВПО «ДонНУ», 2019. – 100 с. | | + |
| 3 | Управление рисками [Электронный ресурс] : библиографический список литературы / [сост. Н. А. Фесенко ; ред. В. А. Кротова] ; Донецкий нац. ун-т, Науч. б-ка, Отд. справ.-библиогр. и информ. работы. - Донецк : ДонНУ, 2016. - электронные данные (1 файл). | | + |
| Наименований основной литературы: 3 | | 0 печатных экземпляров | 3 электронных ресурса |
| Наименования дополнительной литературы | | | |
| | | | Наличие в ЭБС «Университетская библиотека ONLINE» |
| 1 | Балдин, К.В. Управленческие решения / К.В. Балдин, С.Н. Воробьев, В.Б. Уткин. – 8-е изд. – Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2017. – 495 с. | | + |
| 2 | Уколов, А.И. Управление рисками страховой организации / А.И. Уколов. – 2-е изд., стер. – Москва : Директ-Медиа, 2017. – 468 с | | + |
| 3 | Каранина, Е.В. Управление финансовыми рисками: стратегические модели и профессиональные стандарты / Е.В. Каранина. – Санкт-Петербург : ИЦ "Интермедия", 2017. – 168 с. | | + |
| 4 | Кулешова, Е.В. Управление рисками проектов / Е.В. Кулешова ; Министерство образования и науки Российской Федерации, Томский Государственный Университет Систем Управления и Радиоэлектроники (ТУСУР). – 2-е изд., доп. – Томск : Эль Контент, 2015. – 188 с. | | + |
| 5 | Фирсова, О.А. Управление рисками организаций / О.А. Фирсова ; Межрегиональная Академия безопасности и выживания. – Орел : МАБИБ, 2014. – 82 с. | | + |
| 6 | Плотникова, М.С. Управление рисками / М.С. Плотникова. – Москва : Лаборатория книги, 2010. – 108 с | | + |

| | | Кол-во экземпляров в библиотеке ДонНУ | |
|--|--|--|--|
| 7 | Балдин, К. В. Управление рисками : Учеб. пособие для вузов по специальностям экономики и управления (060000) / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. - М. : ЮНИТИ, 2005. - 511 с. | 2 | |
| 8 | Чернова, Г. В. Управление рисками : учеб. пособие / Г. В. Чернова, А. А. Кудрявцев. - М. : Проспект : ТК Велби, 2007. - 160 с. | 2 | |
| 9 | Управление рисками промышленных предприятий : монография / Т. В. Мироненко, И. А. Шиянов ; ГОУ ВПО Донецкий национальный университет. - Донецк : ДонНУ "Норд-Пресс", 2010. - 157 с. | 1 | |
| 10 | Фінансовий менеджмент: навч. посіб. для студ. вищих навч. закладів / В. В. Краснова, Б. О. Жнякін, М. І. Хромов та ін.; за заг. ред. В. В. Красної. — Донецьк: ДонНУ, 2013. - 463 с. | 9 | |
| | | | Наличие электронной версии в ЭБС «Elibrary» |
| 11 | Контроллинг и управление логистическими рисками: учебно-методическое пособие / Г. Г. Левкин. – М.-Берлин: Директ-Медиа, 2015. – 58 с. | | + |
| 12 | Управление рисками деятельности предприятия: учебное пособие/ А.Г. Бадалова, А.В. Пантелеев. - 2-е издание – М.: Вузовская книга , 2016 – 232 с. | | + |
| 13 | Управление рисками: учебное пособие/ В. А. Кабанов, О. В. Набатова; ВолгГТУ. – Волгоград, 2016. – 64 с. | | + |
| 14 | Оценка и управление рисками: анализ временных рядов методами нелинейной динамики: монография / А. М. Кумратова, Е. В. Попова. – Краснодар: КубГАУ, 2014. – 212 с. | | + |
| 15 | Финансовые инструменты управления рисками в инвестиционном проектировании: учебно-практическое пособие / Е.Н. Станиславчик. – М.: Дело и сервис, 2016. – 192 с | | + |
| | | | |
| Наименований дополнительной литературы: 25 | | 14 печатных экземпляров | 11 электронных ресурсов |
| Всего по дисциплине «Управление рисками» Наименований: 28 | | 14 печатных экземпляров | 14 электронных ресурсов |
| Периодические издания | | | |
| № п/п | | Кол-во экземпляров в библиотеке ДонНУ | Наличие электронной версии в ЭБС «Elibrary» |
| 1 | Журнал «Управление финансовыми рисками» WWW-адрес: http://www.grebennikoff.ru/product/23 | | + Доступный архив 2005-2019 |
| 2 | Журнал «Стратегические решения и риск-менеджмент». | | + |

| | | | |
|---|---|--|-----------------------------------|
| | WWW-адрес: http://www.jsdrm.ru | | Доступный архив 2018-2019 |
| 3 | Журнал «Проблемы анализа риска». WWW-адрес: http://www.dex.ru/PAR_information_resource/PAR_journal/archive | | + Доступный архив 2004-2019 |
| 4 | COSO ERM - концептуальные основы управления рисками организаций https://www.pwc.ru/ru/services/audit/riskassurance/enterprise-risk-management/coso-erm.html | | + |
| | Наименований 2 | | 4 электронных ресурса |

15. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Научная библиотека Донецкого национального университета. –Режим доступа: library.donnu.ru
2. Дистанционный курс «Управление рисками». Центр дистанционного образования экономического факультета ДонНУ. – Режим доступа: <http://ef.donnu-support.ru/moodle/course/view.php?id=536>
3. Русское общество Управления Рисками Режим доступа: <http://rrms.ru>
4. Международная ассоциация профессиональных риск-менеджеров - Professional Risk Managers' International Association . Режим доступа: <https://www.prmia.org/>
5. Bloomberg Режим доступа: <https://www.bloomberg.com/europe>

16. ПРОГРАММНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

1. Windows 7 PRO (корпоративная лицензия ДОННУ № 46484614);
2. Microsoft Office (корпоративная лицензия ДОННУ лицензия № 46472919);
3. Microsoft Visual Studio (лицензия программы DreamSpark для высших учебных заведений);
4. Лицензии GPL для свободного программного обеспечения: Антивирус Касперского, Libre Office, Adobe Acrobat Reader, xPDF, Paint.NET.