

Документ подписан посредством электронной подписи

Информация о владельце:

ФИО: Кислова Наталья Николаевна

Должность: Проректор по УМР и качеству образования

Дата подписания: 08.08.2023

Уникальный программный ключ:

52802513f5b14a975b3e9b13008093d5726b159bf6064f865ae65b96a966c035

МИНИСТЕРСТВО ПРОСВЕЩЕНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение

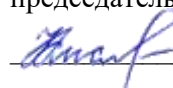
высшего образования

«Самарский государственный социально-педагогический университет»

Кафедра управления, сервисных технологий и экономического образования

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по УМР и КО,
председатель УМС СГСПУ



Н.Н. Кислова

МОДУЛЬ "ОРГАНИЗАЦИОННО-УПРАВЛЕНЧЕСКИЙ"

Управление рисками

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Управления, сервисных технологий и экономического образования**

Учебный план ФЭУС-625ФМв(4г6м)
Направление подготовки: 38.03.01 Экономика и 38.03.02 Менеджмент
Направленность (профиль): «Финансовый менеджмент»

Квалификация **бакалавр**

Форма обучения **очно-заочная**

Общая трудоемкость **5 ЗЕТ**

Часов по учебному плану	180	Виды контроля в семестрах: экзамены 8
в том числе:		
аудиторные занятия	38	
самостоятельная работа	142	

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр(Курс.Номер семестра на курсе)	8(4.2)		Итого	
	УП	РПД	УП	РПД
Лекции	16	16	16	16
Практические	22	22	22	22
В том числе инт.	10	10	10	10
Итого ауд.	38	38	38	38
Контактная работа	38	38	38	38
Сам. работа	142	142	142	142
Итого	180	180	180	180

Программу составил(и):

Лебедева Екатерина Васильевна

При наличии обучающихся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья, которым необходим особый порядок освоения дисциплины (модуля), по их желанию разрабатывается адаптированная к ограничениям их здоровья рабочая программа дисциплины (модуля).

Рабочая программа дисциплины

Управление рисками

разработана в соответствии с ФГОС ВО:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954)

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 970)

составлена на основании учебного плана:

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика и 38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль): «Финансовый менеджмент»

утвержденного Учёным советом СГСПУ от 27.12.2024 протокол № 5.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Управления, сервисных технологий и экономического образования

Протокол от 25.02.2025 г. № 7.

Зав. кафедрой Л.И. Фишман

Начальник УОП



____ Н.А. Доманина

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Цель изучения дисциплины: сформировать заданные ОПОП ВО аспекты компетенций по управлению рисками
Задачи изучения дисциплины: сформировать запланированные образовательные результаты
Область профессиональной деятельности: 08 Финансы и экономика

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Цикл (раздел) ОП: Б1.О.03

2.1 Требования к предварительной подготовке обучающегося:

Содержание дисциплины базируется на материале:

Методы принятия решений

Основы менеджмента

Финансовое планирование на предприятии

Методы оценки рисков финансовых рисков

2.2 Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:

Бизнес-планирование

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ПК-2 Э Проводит оценку влияния рисков на цели, ключевые показатели эффективности и решения, принимаемые в организациях

ПК-2.1 Э Оценивает риски организации с точки зрения их стоимости и вероятности реализации

Знает: основные виды рисков и их классификацию; методику идентификации и оценки рисков.

Умеет: рассчитывать количественные и качественные показатели рисков; аргументировано выбирать решения по противодействию возникновению рисков, их профилактике и ликвидации их последствий исходя из важности и вероятности рисков

ПК-2.2 Э Разрабатывает программу управления рисками организации и сценарии наиболее вероятных рискованных ситуаций

Знает: методы количественного и ситуационного анализа рисков; методы, применяемые на этапе диагностики проблемы; методы и способы идентификации и анализа рисков; основные методы управления рисками предприятия; виды ответственности руководителя за принятые им управленческие решения;

Умеет: выбирать управленческое решение из ряда альтернатив; формулировать цели управленческих решений; определять методы управления рисками предприятия на основе идентификации, анализа и количественной оценки рисков; применять методы оценки рисков предприятия; аргументировано выбирать решения из ряда альтернатив на основе количественного и/или качественного анализа их предполагаемой эффективности.

Владеет: технологией разработки программ управления рисками организации

ПК-2.3 Э Разрабатывает процедуры, направленные на профилактику рискованных ситуаций, ликвидацию последствий их наступления, оздоровление финансово-хозяйственной деятельности организации

Знает: виды рисков и вероятность их наступления в зависимости от развития внутренней и внешней среды организации; методы профилактики рискованных ситуаций; методику анализа рисков; методы ликвидации рискованных ситуаций различных типов

Умеет: разрабатывать процедуры, направленные на профилактику рискованных ситуаций и программу действий, направленную на ликвидацию последствий наступления рисков.

Владеет: технологией расчета вероятности наступления рискованных ситуаций, разработки профилактических процедур в отношении них, технологией ликвидации последствий наступления рискованных событий, в том числе финансово-хозяйственного характера

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр	Часов	Интеракт.
	Раздел 1. Риски: теория, классификация, оценка			
1.1	Определение понятий «риск» и «неопределенность». Общие принципы классификации рисков /Лек/	8	2	0
1.2	Определение понятий «риск» и «неопределенность» /Пр/	8	2	0
1.3	Определение понятий «риск» и «неопределенность» /Ср/	8	24	0
1.4	Общие принципы классификации рисков /Пр/	8	4	0
1.5	Общие принципы классификации рисков /Ср/	8	14	0
1.6	Методология оценки и измерения риска /Лек/	8	4	0
1.7	Методология оценки и измерения риска /Пр/	8	4	2
1.8	Методология оценки и измерения риска /Ср/	8	20	0
1.9	Риск-анализ. Методы анализа рисков /Лек/	8	4	2

1.10	Риск-анализ. Методы анализа рисков /Пр/	8	2	2
1.11	Риск-анализ. Методы анализа рисков /Ср/	8	30	0
1.12	Контрольное мероприятие по разделу 1 /Пр/	8	2	0
Раздел 2. Управление рисками				
2.1	Цели, задачи и принципы управления рисками /Лек/	8	2	0
2.2	Цели, задачи и принципы управления рисками /Пр/	8	2	0
2.3	Цели, задачи и принципы управления рисками /Ср/	8	16	0
2.4	Расчет вероятности наступления рискованных ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий /Лек/	8	2	0
2.5	Расчет вероятности наступления рискованных ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий /Пр/	8	2	2
2.6	Расчет вероятности наступления рискованных ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий /Ср/	8	24	0
2.7	Разработка программы управления рисками организации /Лек/	8	2	0
2.8	Разработка программы управления рисками организации /Пр/	8	2	2
2.9	Разработка программы управления рисками организации /Ср/	8	14	0
2.10	Контрольное мероприятие по разделу 2 /Пр/	8	2	0

5. Оценочные и методические материалы по дисциплине (модулю)

5.1. Содержание аудиторной работы по дисциплине (модулю)

8 семестр, 8 лекций, 11 практических занятий Раздел 1. Риски: теория, классификация, оценка Лекция № 1 (2 часа)

Определение понятий «риск» и «неопределенность». Общие принципы классификации рисков

Вопросы и задания:

1. Разнообразие понятия «риск».
2. Объективная и субъективная природа риска.
3. Разнообразие мнений о сущности риска.
4. Неопределенность как средство появления риска.
5. Источники неопределенности.
6. Особенности экономического подхода к анализу риска.
7. Субъективные и основные факторы, влияющие на оценку риска.
8. Современное общество как общество «риска».
9. Анализ различных подходов к классификации риска.
10. Критерии классификации рисков.
11. Внутренние и внешние риски.
12. Прогнозируемые и непрогнозируемые риски.
13. Ретроспективные, текущие перспективные риски.
14. Чистый и спекулятивный риск.
15. Коммерческие риски, причины возникновения.
16. Кредитный риск.
17. Инновационный риск.

Практическое занятие № 1 (2 часа)

Определение понятий «риск» и «неопределенность»

Вопросы и задания:

1. Разнообразие понятия «риск». Риск как выбор, действие, вероятность.
2. Объективная и субъективная природа риска.
3. Неопределенность как средство появления риска.
3. Экономические источники неопределенности. Социокультурные источники неопределенности. Политические источники неопределенности. Природные источники неопределенности.
4. Субъективные и основные факторы, влияющие на оценку риска.

Практические занятия № 2-3 (4 часа)

Общие принципы классификации рисков

Вопросы:

1. Подходов к классификации риска.
 2. Критерии классификации рисков.
 3. Основные виды рисков
 4. Известные, предвиденные и непредвиденные риски.
 3. Прогнозируемые и непрогнозируемые риски.
 4. Ретроспективные, текущие, перспективные риски.
 4. Внутренние и внешние риски.
- Задание: на примере конкретной организации составьте классификацию рисков ее деятельности
- Лекции № 2-3 (4 часа)

Методология оценки и измерения риска

Вопросы и задания:

1. Идентификация и оценка рисков
2. Информационное обеспечение системы выявления рисков.
3. Основные подходы к выявлению риска.
4. Схемы оценки рисков в условиях неопределенности.
5. Матрицы последствий и рисков.
6. Анализ решений в условиях неопределенности.

Практические занятия № 4-5 (4 часа)

Методология оценки и измерения риска

Вопросы:

Приемы оценки и измерения рисков

1. Роль информации в выявлении рисков.
2. Оценка рисков в условиях неопределенности
3. Идентификация и оценка рисков.
4. Количественный и качественный подходы к оценке рисков
5. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности

Задание: на примере конкретной ситуации в конкретной организации проведите идентификацию и оценку рисков и на их основании примите управленческое решение из ряда альтернатив

Лекции № 4-5 (4 часа)

Риск-анализ. Методы анализа рисков

1. Мера риска.
2. Разработка сценариев эволюции окружающей среды и определение факторов риска.
3. Факторы прямого воздействия и факторы косвенного воздействия.
4. Риск ближней окружающей среды.
5. Отраслевой риск.
6. Анализ возможного проявления рисков внутриотраслевой конкуренции.
7. Основные этапы анализа риска.
8. Оценка рисков.
9. Волантильность и чувствительность критериев деятельности к их последствиям.
10. Анализ риска конкуренции.
11. Количественный подход к оценке рисков.
12. Использование методов математической статистики.
13. Метод эквивалентов.
14. Анализ чувствительности.
15. Анализ сценариев.
16. Недостатки количественных методов.
17. Качественный подход к измерению риска.
18. Метод экспертных оценок.
19. Метод аналогий
20. Измерение степени риска.
21. Методы диагностики рисков.

Практическое занятие № 6 (2 часа)

Риск-анализ. Методы анализа рисков

Вопросы:

1. Понятие риск-анализа.
2. Мера риска.
3. Факторы, влияющие на уровень риска. Факторы прямого воздействия и факторы косвенного воздействия.
4. Основные этапы анализа риска.
5. Качественный подход к оценке рисков. Методы качественного анализа рисков.
6. Количественный подход к оценке рисков. Методы количественного анализа рисков.

Задание : на примере конкретной ситуации в конкретной организации проведите качественный и количественный анализ рисков; составьте матрицу рисков.

Практическое занятие № 7 (2 часа)

Контрольное мероприятие по разделу 1

Раздел 2. Управление рисками

Лекция № 6 (2 часа)

Цели, задачи и принципы управления рисками

Вопросы и задания:

1. Цель анализа рисков.
2. Понятие «риск-менеджмент».
3. Формы управления в бизнесе.
4. Методы и процедуры управления рисками.
5. Требования к управлению рисками.
6. Стратегическое и оперативное управление.
7. Организация управления рисками.
8. Этапы управления рисками.

9. Методы управления рисками.			
Практическое занятие № 8 (2 часа)			
Цели, задачи и принципы управления рисками			
Вопросы:			
1. Цели управления рисков в бизнесе.			
2. Формы управления риском в бизнесе: активная, адаптивная и консервативная.			
3. Современные требования к управлению рисками.			
4. Система управления рисками в бизнесе.			
5. Методы управления рисками. Уклонение от риска. Диверсификация. Страхование рисков. Лимитирование.			
Задание: На примере конкретной организации опишите наиболее приемлемые методы управления рисками в различных ситуациях неопределённости и риска.			
Лекция № 7 (2 часа)			
Расчет вероятности наступления рискованных ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий			
Вопросы и задания:			
1. Количественный подход к оценке рисков.			
2. Использование методов математической статистики.			
3. Метод эквивалентов.			
4. Анализ чувствительности.			
5. Анализ сценариев.			
6. Недостатки количественных методов.			
7. Качественный подход к измерению риска.			
8. Метод экспертных оценок.			
9. Метод аналогий.			
10. Измерение степени риска.			
11. Методы диагностики рисков.			
12. Разработка мер по профилактике рисков.			
13. Система мер по ликвидации последствий наступления рискованных событий.			
Практическое занятие № 9 (2 часа)			
Расчет вероятности наступления рискованных ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий			
Вопросы и задания:			
1. Отраслевое управление рисками			
2. Управление банковскими рисками			
3. Управление рисками, возникающими при лизинговом инвестировании			
4. Риск-менеджмент в сфере агропромышленного производства			
5. Хеджирование рисков			
6. Риск-менеджмент в разрезе инвестиционной стратегии			
Лекция № 8 (2 часа)			
Разработка программы управления рисками организации			
Вопросы и задания:			
1. Цикличность процедур управления рисками.			
2. Система управления рисками в организации.			
3. Структуры управления рисками в организации.			
4. Программа непрерывного управления рисками.			
5. Матрица рисков.			
6. Паспорт рисков.			
7. Реестр рисков			
Практическое занятие № 10 (2 часа)			
Разработка программы управления рисками организации			
Вопросы:			
1. Управление рисками как система менеджмента.			
2. Функции риск-менеджмента			
3. Организация риск-менеджмента			
4. Правила риск-менеджмента			
5. Информационное обеспечение управления рисками			
6. Методы финансирования рисков.			
Задание: на примере конкретной организации постройте программу управления рисками			
Практическое занятие № 11 (2 часа)			
Контрольное задание по разделу 2.			
5.2. Содержание самостоятельной работы по дисциплине (модулю)			
Содержание обязательной самостоятельной работы по дисциплине			
№ п/п	Темы дисциплины	Содержание самостоятельной работы	Продукты деятельности
1	Определение понятий «риск» и «неопределенность»	Разнообразие понятия «риск». Риск как выбор, действие, вероятность. Факторы, влияющие на оценку риска	Реферат
2	Общие принципы классификации рисков		

3	Методология оценки и измерения риска		
4	Риск-анализ. Методы анализа рисков	Особенности риск-анализа. Методы анализа рисков	Самостоятельная работа
5	Цели, задачи и принципы управления рисками	Современные требования к управлению рисками	Реферат
6	Расчет вероятности наступления рискованных ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий		
7	Разработка программы управления рисками организации		

Содержание самостоятельной работы по дисциплине на выбор

№ п/п	Темы дисциплины	Содержание самостоятельной работы	Продукты деятельности
1	Общие принципы классификации рисков	Виды рисков (на примере конкретной организации)	Самостоятельная письменная работа
2	Методология оценки и измерения риска	Оценка и измерение риска (на примере конкретной организации)	Самостоятельная письменная работа
3	Расчет вероятности наступления рискованных ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий	Моделирование рискованной ситуации (на примере конкретной организации) предприятия	Письменная аналитическая работа
4	Разработка программы управления рисками организации	Организация риск-менеджмента (на примере конкретной организации)	Письменная аналитическая работа

5.3.Образовательные технологии

При организации изучения дисциплины будут использованы следующие образовательные технологии: информационно-коммуникационные технологии, технология организации самостоятельной работы, технология рефлексивного обучения, технология модульного обучения, технология игрового обучения, технологии групповой дискуссии, интерактивные технологии, технология проблемного обучения, технология организации учебно-исследовательской деятельности, технология проектного обучения, технология развития критического мышления.

5.4. Текущий контроль, промежуточный контроль и промежуточная аттестация

Балльно-рейтинговая карта дисциплины оформлена как приложение к рабочей программе дисциплины. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине оформлен отдельным документом.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

Дата обращения к электронным учебным изданиям, электронным образовательным ресурсам, современным базам данных и информационным справочным системам совпадает с датой утверждения рабочей программы

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Каранина Е.В.	Управление рисками : механизмы, инструменты, профессиональные стандарты: учебник https://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=576521	Берлин: Директ-Медиа, 2020.
Л1.2	Фомичев А. Н	Риск-менеджмент: учебник http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=45389	Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2016
Л1.3	Рахимова Н. Н.	Управление рисками, системный анализ и моделирование: учебное пособие http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=469596	Оренбург: ОГУ, 2016

6.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Воробьев С. Н. Балдин К. В.	Управление рисками: учебное пособие http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=117545	Москва: Юнити-Дана, 2012
Л2.2	Бакаева Т.Н. Дмитриева И.А. Толмачёва Л. В.	Управление профессиональными рисками: учебное пособие https://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=492973	Таганрог: Южный федеральный университет, 2016
Л2.3	Черняков М. К. Чернякова М.М.	Управление рисками : конспект лекций: учебное пособие https://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=574663	Новосибирск: Новосибирский государственный технический университет, 2018

6.2 Перечень программного обеспечения

- Acrobat Reader DC
 - Dr.Web Desktop Security Suite, Dr.Web Server Security Suite

- GIMP
- Microsoft Office 365 Pro Plus - subscription license (12 month).
- Microsoft Windows 10 Education
- XnView
- Архиватор 7-Zip
6.3 Перечень информационных справочных систем, профессиональных баз данных
- ЭБС «Университетская библиотека онлайн»
- Базы данных Springer eBooks
- 1С:ИТС ПРОФ ВУЗ
- СПС «ГАРАНТ-Аналитик»
- СПС «Консультант-Плюс»

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
7.1	Наименование специального помещения: учебная аудитория для проведения практических занятий, групповых консультаций, индивидуальных консультаций, текущего контроля, промежуточной аттестации, Учебная аудитория. Оснащенность: Меловая доска-1шт., Комплект учебной мебели, ноутбук, проекционное оборудование (мультимедийный проектор и экран).
7.2	Наименование специального помещения: помещение для самостоятельной работы, Читальный зал. Оснащенность: ПК-4шт. с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду СГСПУ, Письменный стол-4 шт., Парта-2 шт.

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
Работа над теоретическим материалом происходит кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометить важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю. Проработка рабочей программы дисциплины, уделяя особое внимание целям и задачам, структуре и содержанию дисциплины. Конспектирование источников, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы, работа с информационными источниками в разных форматах. Также в процессе изучения дисциплины методические рекомендации могут быть изданы отдельным документом.	

Балльно-рейтинговая карта дисциплины «Управление рисками»

Курс 4 Семестр 8

Вид контроля		Минимальное количество баллов	Максимальное количество баллов
Наименование раздела: «Риски: теория, классификация, оценка»			
Текущий контроль по разделу:		18	30
1	Аудиторная работа	6	10
2	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	6	10
3	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор)	6	10
Контрольное мероприятие по разделу		10	20
Промежуточный контроль		28	50
Наименование раздела: «Управление рисками»			
Текущий контроль по разделу:		18	30
1	Аудиторная работа	6	10
2	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	6	10
3	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор)	6	10
Контрольное мероприятие по разделу		10	20
Промежуточный контроль		28	50
Промежуточная аттестация		56	100
Итого:		56	100

Виды контроля		Перечень или примеры заданий, критерии оценки и количество баллов	Темы для изучения и образовательные результаты
Текущий контроль по разделу «Риски: теория, классификация, оценка»			
1	Аудиторная работа	6-10 баллов Пример задания: Дайте ответы на следующие вопросы: 1. Сформулируйте понятие «риска» 2. Назовите принципы классификации рисков 3. Перечислите основные виды рисков 4. Дайте определение понятиям «оценка риска» и «идентификация риска» 5. Назовите основные методы оценки и идентификации рисков Критерии оценки: Сформулировано понятие «риска» - 1 балл, 1. Названы принципы классификации рисков – 1 балл, 2. Перечислены основные виды рисков – 3 балла, 3. Дано определение понятиям «оценка риска» и «идентификация риска» - 2 балла, 4. Названы основные методы оценки и идентификации рисков – 3 балла. Максимум 10 баллов	Определение понятий «риск» и «неопределенность» Общие принципы классификации рисков Методология оценки и измерения риска Риск-анализ. Методы анализа рисков Образовательные результаты: Знает: основные виды рисков и их классификацию; методику идентификации и оценки рисков.
2	Самостоятельная работа (обязательные формы)	6-10 баллов 1. Назовите методы количественного и качественного анализа рисков. 2. Назовите методы, применяемые на этапе диагностики проблемы, связанных с рисками. 3. Назовите методы и способы идентификации и анализа рисков.	Определение понятий «риск» и «неопределенность» Общие принципы классификации рисков Методология оценки и измерения риска Риск-анализ. Методы анализа рисков

		4. Назовите основные методы управления рисками предприятия. 5. Назовите виды ответственности руководителя за принятые им управленческие решения; Оценочный лист к типовому заданию: Критерии оценки: 1. Перечислены методы количественного и качественного анализа рисков – до 2 баллов; 2. Перечислены методы, применяемые на этапе диагностики проблемы, связанных с рисками – до 2 баллов; 3. Перечислены методы и способы идентификации и анализа рисков – до 2 баллов; 4. Перечислите основные методы управления рисками предприятия – до 2 баллов; 5. Перечислите виды ответственности руководителя за принятые им управленческие решения – до 2 баллов. Максимум 10 баллов	Образовательные результаты: Знает: методы количественного и ситуационного анализа рисков; методы, применяемые на этапе диагностики проблемы; методы и способы идентификации и анализа рисков; основные методы управления рисками предприятия; виды ответственности руководителя за принятые им управленческие решения;																																																						
3	Самостоятельная работа (на выбор)	6-10 баллов На примере конкретной организации: 1. Проведите количественный и качественный анализ рисков. 2. Проранжируйте риски организации исходя из их важности и вероятности Оценочный лист к типовому заданию: <table border="1"> <thead> <tr> <th rowspan="3">Критерий</th><th colspan="3">Оценка соответствия</th></tr> <tr> <th>Соответствует полностью</th><th>Соответствует частично</th><th>Не соответствует</th></tr> <tr> <th>1</th><th>0,5</th><th>0</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Выделены основные риски для организации</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Выделены риски, специфичные для организации</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Выявлены риски, специфичные для отрасли, в которой работает организация</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Определены внешние риски организации</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Определены внутренние риски организации</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Проведен качественный анализ рисков</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Проведен количественный анализ рисков</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Риски проранжированы степени вероятности</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Риски проранжированы по степени важности</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Составлена матрица рисков</td><td></td><td></td><td></td></tr> <tr> <td>Количество баллов</td><td>10</td><td>5</td><td>0</td></tr> </tbody> </table>	Критерий	Оценка соответствия			Соответствует полностью	Соответствует частично	Не соответствует	1	0,5	0	Выделены основные риски для организации				Выделены риски, специфичные для организации				Выявлены риски, специфичные для отрасли, в которой работает организация				Определены внешние риски организации				Определены внутренние риски организации				Проведен качественный анализ рисков				Проведен количественный анализ рисков				Риски проранжированы степени вероятности				Риски проранжированы по степени важности				Составлена матрица рисков				Количество баллов	10	5	0	Общие принципы классификации рисков Методология оценки и измерения риска Образовательные результаты: Умеет: рассчитывать количественные и качественные показатели рисков; аргументировано выбирать решения по противодействию возникновению рисков, их профилактике и ликвидации их последствий исходя из важности и вероятности рисков Знает: методы количественного и ситуационного анализа рисков; методы, применяемые на этапе диагностики проблемы; методы и способы идентификации и анализа рисков; основные методы управления рисками предприятия; виды ответственности руководителя за принятые им управленческие решения;
Критерий	Оценка соответствия																																																								
	Соответствует полностью	Соответствует частично		Не соответствует																																																					
	1	0,5	0																																																						
Выделены основные риски для организации																																																									
Выделены риски, специфичные для организации																																																									
Выявлены риски, специфичные для отрасли, в которой работает организация																																																									
Определены внешние риски организации																																																									
Определены внутренние риски организации																																																									
Проведен качественный анализ рисков																																																									
Проведен количественный анализ рисков																																																									
Риски проранжированы степени вероятности																																																									
Риски проранжированы по степени важности																																																									
Составлена матрица рисков																																																									
Количество баллов	10	5	0																																																						
	Контрольное мероприятие по разделу	10-20 баллов На примере конкретной организации: 1. Выберите конкретные методы оценки рисков 2. Проведите анализ рисков	Образовательные результаты: Умеет: рассчитывать количественные и качественные показатели рисков; аргументировано выбирать решения по противодействию возникновению рисков, их																																																						

	3. Сформулируйте альтернативы развития рискованных событий. 4. Проанализируйте альтернативы (сценарии) развития рискованных событий с применением количественного и/или качественного анализа их предполагаемой эффективности 5. Выберите одно (лучшее) решение из ряда альтернатив сценариев. Обоснуйте свой выбор Критерии оценки 6. Выбраны конкретные методы оценки рисков – до 4 баллов 7. Проведен анализ рисков – до 8 баллов; 8. Сформулированы альтернативы развития рискованных событий – до 3 баллов; 9. Проанализированы альтернативы (сценарии) развития рискованных событий с применением количественного и/или качественного анализа их предполагаемой эффективности – до 4 баллов; 10. Выбран и обоснован одно (лучшее) решение из ряда альтернатив сценариев – до 3 баллов. Максимум – 20 баллов	профилактике и ликвидации их последствий исходя из важности и вероятности рисков Умеет: выбирать управленческое решение из ряда альтернатив; формулировать цели управленческих решений; определять методы управления рисками предприятия на основе идентификации, анализа и количественной оценки рисков; применять методы оценки рисков предприятия; аргументировано выбирать решения из ряда альтернатив на основе количественного и/или качественного анализа их предполагаемой эффективности. Владеет: технологией разработки программ управления рисками организации
Промежуточный контроль (количество баллов)	28-50 баллов	
Текущий контроль по разделу «Управление рисками»		
1	Аудиторная работа 6-10 баллов Пример задания: Дайте ответ на следующие вопросы: 1. Как внутренняя среда влияет на развитие ситуации неопределённости и риска? 2. Как внешняя среда влияет на развитие ситуации неопределённости и риска? 3. Назовите виды рисков, связанных с внутренней средой организации. 4. Назовите виды рисков, связанных с внешней средой организации. 5. Перечислите методы профилактики рисков, связанных с внутренней средой организации. 6. Перечислите методы профилактики рисков, связанных с внутренней средой организации. 7. Назовите методы анализа рисков, связанных с внутренней средой организации. 8. Назовите методы анализа рисков, связанных с внешней средой организации. 9. Перечислите методы ликвидации рискованных ситуаций, связанных с внутренней средой организации. 10. Перечислите методы ликвидации рискованных ситуаций, связанных с внешней средой организации. Оценочный лист к типовому заданию: Критерии оценки: 1. Перечислено как внутренняя среда влияет на развитие ситуации неопределённости и риска – от 0,5 до 1 балла; 2. Перечислено, как внешняя среда влияет на развитие ситуации неопределённости и риска – от 0,5 до 1 балла; 3. Названы виды рисков, связанных с внутренней средой организации – от 0,5 до 1 балла; 4. Названы виды рисков, связанных с внешней средой организации – от 0,5 до 1 балла; 5. Перечислены методы профилактики рисков, связанных с внутренней средой организации – от 0,5 до 1 балла; 6. Перечислены методы профилактики рисков, связанных с внутренней средой организации – от 0,5 до 1 балла; 7. Названы методы анализа рисков, связанных с внутренней средой организации – от 0,5 до 1 балла; 8. Названы методы анализа рисков, связанных с внешней средой организации – от 0,5 до 1 балла;	Цели, задачи и принципы управления рисками Расчет вероятности наступления рискованных ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий Разработка программы управления рисками организации Образовательные результаты: Знает: виды рисков и вероятность их наступления в зависимости от развития внутренней и внешней среды организации; методы профилактики рискованных ситуаций; методику анализа рисков; методы ликвидации рискованных ситуаций различных типов

		9. Перечислены методы ликвидации рисковых ситуаций, связанных с внутренней средой организации – от 0,5 до 1 балла; 10. Перечислены методы ликвидации рисковых ситуаций, связанных с внешней средой организации – от 0,5 до 1 балла.																																			
2	Самостоятельная работа (обязательные формы)	6-10 баллов. Пример задания: На примере конкретной организации 1. Проведите расчет вероятности наступления рисковых ситуаций. 2. Разработайте процедуры профилактики в отношении наиболее важных и опасных рисков. 3. Разработайте технологией ликвидацию последствий наступления наиболее важных и опасных рисковых Критерии оценки: <table><tr><th rowspan="3">Критерий</th><th colspan="3">Оценка соответствия</th></tr><tr><th>Соответствует полностью</th><th>Соответствует частично</th><th>Не соответствует</th></tr><tr><th>2</th><th>1</th><th>0</th></tr><tr><td>Выделены, проанализированы и идентифицированы риски организации</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Проведен расчет вероятности наступления рисковых ситуаций</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Разработаны процедуры профилактики в отношении наиболее важных и опасных рисков</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Разработаны технологии ликвидацию последствий наступления наиболее важных и опасных рисковых ситуаций</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Разработаны технологии ликвидацию последствий наступления наиболее важных и опасных рисковых ситуаций финансово-хозяйственного характера</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Количество баллов</td><td>10</td><td>5</td><td>0</td></tr></table>	Критерий	Оценка соответствия			Соответствует полностью	Соответствует частично	Не соответствует	2	1	0	Выделены, проанализированы и идентифицированы риски организации				Проведен расчет вероятности наступления рисковых ситуаций				Разработаны процедуры профилактики в отношении наиболее важных и опасных рисков				Разработаны технологии ликвидацию последствий наступления наиболее важных и опасных рисковых ситуаций				Разработаны технологии ликвидацию последствий наступления наиболее важных и опасных рисковых ситуаций финансово-хозяйственного характера				Количество баллов	10	5	0	Цели, задачи и принципы управления рисками Расчет вероятности наступления рисковых ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий Разработка программы управления рисками организации Образовательные результаты: Владеет: технологией расчета вероятности наступления рисковых ситуаций, разработки профилактических процедур в отношении них, технологией ликвидацию последствий наступления рисковых событий, в том числе финансово-хозяйственного характера
Критерий	Оценка соответствия																																				
	Соответствует полностью	Соответствует частично		Не соответствует																																	
	2	1	0																																		
Выделены, проанализированы и идентифицированы риски организации																																					
Проведен расчет вероятности наступления рисковых ситуаций																																					
Разработаны процедуры профилактики в отношении наиболее важных и опасных рисков																																					
Разработаны технологии ликвидацию последствий наступления наиболее важных и опасных рисковых ситуаций																																					
Разработаны технологии ликвидацию последствий наступления наиболее важных и опасных рисковых ситуаций финансово-хозяйственного характера																																					
Количество баллов	10	5	0																																		
3	Самостоятельная работа (на выбор)	6-10 баллов Пример задания: На примере конкретной организации: 1. Разработайте перечень факторов рисков организации. 2. Проведите расчеты важности и вероятности рисковых ситуаций. 3. Проранжируйте риски. 4. Проведите анализ чувствительности рисков 5. Проведите анализ эластичности рисков. 6. Рассчитайте шкалу зон риска. 7. Составьте матрицу рисков организации. Критерии оценки: <table><tr><th>Критерий</th><th>Оценка соответствия</th></tr></table>	Критерий	Оценка соответствия	Цели, задачи и принципы управления рисками Расчет вероятности наступления рисковых ситуаций и разработка мер по их профилактике и ликвидации их последствий Разработка программы управления рисками организации Образовательные результаты: Знает: виды рисков и вероятность их наступления в зависимости от развития внутренней и внешней среды организации; методы профилактики рисковых ситуаций; методику анализа рисков; методы ликвидации рисковых ситуаций различных типов																																
Критерий	Оценка соответствия																																				

			Соответствует полностью	Соответствует частично	Не соответствует		Умеет: разрабатывать процедуры, направленные на профилактику рисковых ситуаций и программу действий, направленную на ликвидацию последствий наступления рисков.
			1	0,5	0		
		Перечислены факторы рисков организации					
		Составлена классификация рисков организации					
		Проведены расчеты рисков организации по важности					
		Проведены расчеты рисков организации по степени опасности					
		Риски организации проранжированы					
		Проведен анализ чувствительности рисков					
		Проведен анализ эластичности рисков					
		Рассчитана шкала зон рисков					
		Составлена матрица рисков					
		Матрица рисков содержит не менее 25 рисков					
Контрольное мероприятие по разделу	10-20 баллов Пример задания: На примере конкретной организации 1. Проведите расчет вероятности наступления рисковых ситуаций. 2. Процедуры, направленные на профилактику рисковых ситуаций; 3. программу действий, направленную на ликвидацию последствий наступления рисков Оценочный лист к типовому заданию (модельный ответ):	Критерий	Оценка соответствия				
			Соответствует полностью	Соответствует частично	Не соответствует		
			2	1	0		
		Выделены, проанализированы и идентифицированы риски организации					
		Проведен расчет вероятности наступления рисковых ситуаций					
		Разработаны процедуры профилактики в отношении наиболее важных и опасных рисков					
		Разработаны технологии ликвидацию последствий наступления наиболее важных и опасных рисковых ситуаций					
		Разработаны технологии ликвидацию последствий наступления наиболее					

Образовательные результаты: Умеет: разрабатывать процедуры, направленные на профилактику рисковых ситуаций и программу действий, направленную на ликвидацию последствий наступления рисков. Владеет: технологией расчета вероятности наступления рисковых ситуаций, разработки профилактических процедур в отношении них, технологией ликвидацию последствий наступления рисковых событий, в том числе финансово-хозяйственного характера

	важных и опасных рисков ситуаций финансово-хозяйственного характера					
	Определены, классифицированы и проранжированы основные риски организации; выявлены риски, в отношении которых необходимо провести профилактические мероприятия, и риски, которые требуют действий по ликвидации их последствий					
	Сформирована программа мероприятий по профилактике рисков ситуация с указанием их важности и опасности возникновения					
	Программа мероприятий по профилактике рисков ситуация включает в себя ответственных лиц и заложенные ресурсы					
	Программа действий по ликвидации последствий рисков включает мероприятия, направленные на все основные виды рисков организации					
	Программа действий ликвидации по последствиям наступления рисков, включает в себя ответственных лиц и заложенные ресурсы					
	Количество баллов	20	10	0		
	Промежуточный контроль (количество баллов)	28-50 баллов				
Промежуточная аттестация	Представлены в фонде оценочных средств для промежуточной аттестации по дисциплине					