

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ВОРОНЕЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ИНЖЕНЕРНЫХ ТЕХНОЛОГИЙ»

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе

_____ Васilenko B.H.
(подпись) (ф.И.О.)

«25» мая 2023 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА
ДИСЦИПЛИНЫ

КОРПОРАТИВНЫЕ СИСТЕМЫ РИСК - МЕНЕДЖМЕНТА
(наименование в соответствии с РУП)

Направление подготовки (специальность)

38.04.02 Менеджмент

(шифр и наименование направления подготовки/специальности)

Направленность (профиль)

Системный менеджмент

_____ (наименование профиля/специализации)

Квалификация выпускника

магистр

Воронеж

1. Цели и задачи дисциплины

Целью освоения дисциплины (модуля) «Корпоративные системы риск - менеджмента» является формирование компетенций обучающегося в области профессиональной деятельности и сфере профессиональной деятельности:

08 Финансы и экономика (в сфере внутреннего и внешнего финансового контроля и аудита, финансового консультирования, управления рисками, организации закупок);

В рамках освоения программы магистратуры выпускники могут готовиться к решению задач профессиональной деятельности следующих типов: информационно-аналитический; организационно-управленческий; финансовый; научно-исследовательский.

Программа составлена в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.04.02 Менеджмент (уровень образования - магистратура).

2. Перечень планируемых результатов обучения, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

| № п/п | Код компетенции | Формулировка компетенции | Код и наименование индикатора достижения компетенции |
|-------|-----------------|---|---|
| 1 | ПКв-1 | Способен планировать, координировать и обеспечивать интегрированную комплексную деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации | ИД1 _{ПКв-1} - Использует принципы, определяет цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации в соответствии со стратегическими целями организации |
| | | | ИД2 _{ПКв-1} - Планирует, контролирует и осуществляет профессиональную деятельность в сфере управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации |
| 1 | ПКв-2 | Способен давать рекомендации и обеспечивать взаимодействие между заинтересованными сторонами по вопросам управления рисками с целью устойчивого развития организации | ИД1 _{ПКв-2} – Изучает, анализирует и оценивает предпринимательскую среду организации с целью разработки предложений по снижению рисков |
| | | | ИД2 _{ПКв-2} – Обеспечивает взаимодействие и консультирование заинтересованных сторон по вопросам управления предпринимательскими рисками с целью устойчивого развития организации |

| Код и наименование индикатора достижения компетенции | Результаты обучения (показатели оценивания) |
|---|---|
| ИД1 _{ПКв-1} - Использует принципы, определяет цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации в соответствии со стратегическими целями организации | Знает: Принципы построения систем управления рисками |
| | Умеет: Организовывать процесс управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов |
| | Имеет навыки: Использования принципов построения системы управления рисками в обеспечении деятельности организации |
| ИД2 _{ПКв-1} - Планирует, контролирует и осуществляет профессиональную деятельность в сфере управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации | Знает: Полномочия и обязательства менеджмента по реализации плана управления рисками |
| | Умеет: Разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками |
| | Имеет навыки: Коммуникации и консультации с заинтересованными сторонами на всех стадиях процесса управления рисками |
| ИД1 _{ПКв-2} – Изучает, анализирует и оценивает предпринимательскую среду организации с целью | Знает: Основные методологии управления рисками |
| | Умеет: Анализировать корпоративные нормативные акты, информацию о порядке и особенностях выполнения действий по |

| | |
|--|--|
| разработки предложений по снижению рисков | управлению рисками и эффективность выполнения этих действий |
| | Имеет навыки: Согласования методологий по управлению рисками в организации |
| ИД2 _{ПКв-2} – Обеспечивает взаимодействие и консультирование заинтересованных сторон по вопросам управления предпринимательскими рисками с целью устойчивого развития организации | Знает: Основы управления проектами |
| | Умеет: Применять стандарты в области риск-менеджмента и лучшие практики в области создания и поддержания культуры управления рисками в организации |
| | Имеет навыки: Реализации специальных проектов по управлению рисками по запросу руководства |

3. Место дисциплины (модуля) в структуре ООП ВО/СПО

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 ООП. Дисциплина является обязательной к изучению.

Изучение дисциплины основано на знаниях, умениях и навыках, полученных при изучении обучающимися дисциплин:

Системный бренд-менеджмент
 Инновационное предпринимательство
 Анализ эффективности управленческой деятельности
 Корпоративный менеджмент
 Моделирование бизнес-процессов
 Менеджмент финансов

Разработка и принятие управленческих решений / Системный анализ и аналитические исследования

Дисциплина является предшествующей для изучения последующих дисциплин, практик:

Управленческий консалтинг
 Менеджмент конкурентоспособности
 Стратегическое управление
 Учебная практика, ознакомительная практика
 Учебная практика, научно-исследовательская работа
 Производственная практика, преддипломная практика
 Производственная практика, практика по профилю профессиональной деятельности
 Производственная практика, технологическая (проектно-технологическая) практика
 Производственная практика, научно-исследовательская работа
 подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена
 подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы

4. Объем дисциплины (модуля) и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 3 зачетные единицы.

| Виды учебной работы | Всего академических часов, ч | Распределение трудоемкости по семестрам, ак.ч |
|--|------------------------------|---|
| | | 2 семестр |
| Общая трудоемкость дисциплины (модуля) | 108,00 | 108,00 |
| Контактная работа в т. ч. аудиторные занятия: | 39,05 | 39,05 |
| Лекции | 19,00 | 19,00 |
| <i>в том числе в форме практической подготовки</i> | - | - |
| Практические занятия | 19,00 | 19,00 |
| <i>в том числе в форме практической подготовки</i> | 19,00 | 19,00 |

| | | |
|---|--------------|--------------|
| Консультации текущие | 0,95 | 0,95 |
| Вид аттестации (зачет) | 0,10 | 0,10 |
| Самостоятельная работа: | 68,95 | 68,95 |
| Проработка материалов по лекциям, учебникам, учебным пособиям | 9,50 | 9,50 |
| Подготовка к практическим занятиям | 9,50 | 9,50 |
| РПР | 10,00 | 10,00 |
| Другие виды самостоятельной работы | 39,95 | 39,95 |

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

5.1 Содержание разделов дисциплины (модуля)

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Содержание раздела (указываются темы и дидактические единицы) | Трудоемкость раздела, ак. ч |
|-------|--|---|-----------------------------|
| 1 | Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента | Основные определения и понятия риск-менеджмента. Принципы, цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации. Организация риск-менеджмента. Угрозы и опасности. | 14 |
| 2 | Управление рисками, как система менеджмента | Концепция, цели и задачи системы управления рисками. Система управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации. Методы управления рисками. Методы уклонения от риска. | 14 |
| 3 | Система управления риском. Анализ, управление, контроллинг | Анализ рисков. Реагирование на риск. Воздействие на риск. Информация и коммуникации. Контроллинг. Основные этапы процесса управления рисками. Анализ и оценка предпринимательской среды организации с целью разработки предложений по снижению рисков | 23 |
| 4 | Внутренний контроль и управление рисками корпораций | Понятие внутреннего контроля. Принципы системы внутреннего контроля и риск менеджмента, способствующие получению оптимального результата деятельности организации. Создание системы внутреннего контроля и риск-менеджмента. Взаимосвязанные компоненты, обеспечивающие эффективное управление рисками в компании. Оценка рыночных возможностей и угроз с точки зрения стратегии развития компании. | 14,5 |
| 5 | Риск-менеджмент в инвестиционной стратегии | Инвестиционная деятельность. Этапы инвестиционной деятельности. Инвестиционное проектирование и риск. Этапы исследования риска в процессе создания инновации. Система управления риском как инновационный проект. Особенности взаимодействия и консультирования заинтересованных сторон по вопросам управления предпринимательскими рисками с целью устойчивого развития организации | 18,45 |
| 6 | Типичные ошибки риск-менеджмента | Типичные ошибки профессиональной деятельности руководства в сфере управления отдельными видами рисков. Многозначность (нечёткость) определений и понятий. Отсутствие комплекса стандартов РФ и ошибки перевода зарубежных стандартов риск-менеджмента. Противоречивые понятия (спекулятивный риск). Ошибки идентификации. Ошибки эксплуатации. | 23 |

| | | |
|--|-----------------------------|------|
| | <i>Консультации текущие</i> | 0,95 |
| | <i>Зачет</i> | 0,10 |

5.2 Разделы дисциплины и виды занятий

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Лекции, ак. ч | Практические занятия, ак. ч | СРО, ак. ч |
|----------|--|---------------|-----------------------------|------------|
| 1 | Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента | 2 | 2 | 10 |
| 2 | Управление рисками, как система менеджмента | 2 | 2 | 10 |
| 3 | Система управления риском. Анализ, управление, контроллинг | 4 | 4 | 15 |
| 4 | Внутренний контроль и управление рисками корпораций | 2 | 2 | 10,5 |
| 5 | Риск-менеджмент в инвестиционной стратегии | 4 | 4 | 10,45 |
| 6 | Типичные ошибки риск-менеджмента | 5 | 5 | 13 |
| | <i>Консультации текущие</i> | | 0,95 | |
| | <i>Зачет</i> | | 0,10 | |

5.2.1 Лекции

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Тематика лекционных занятий | Трудоемкость, ак. ч |
|----------|--|---|---------------------|
| 1 | Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента | Основные определения и понятия риск-менеджмента. Принципы, цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации. Организация риск-менеджмента. Угрозы и опасности. | 2 |
| 2 | Управление рисками, как система менеджмента | Концепция, цели и задачи системы управления рисками. Система управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации. Методы управления рисками. Методы уклонения от риска. | 2 |
| 3 | Система управления риском. Анализ, управление, контроллинг | Анализ рисков. Реагирование на риск. Воздействие на риск. Информация и коммуникации. Контроллинг. Основные этапы процесса управления рисками. Анализ и оценка предпринимательской среды организации с целью разработки предложений по снижению рисков | 4 |
| 4 | Внутренний контроль и управление рисками корпораций | Понятие внутреннего контроля. Принципы системы внутреннего контроля и риск менеджмента, способствующие получению оптимального результата деятельности организации. Создание системы внутреннего контроля и риск-менеджмента. Взаимосвязанные компоненты, обеспечивающие эффективное управление рисками в компании. Оценка рыночных возможностей и угроз с точки зрения стратегии развития компании. | 2 |
| 5 | Риск-менеджмент в инвестиционной стратегии | Инвестиционная деятельность. Этапы инвестиционной деятельности. Инвестиционное проектирование и риск. Этапы исследования риска в процессе создания инновации. Система управления риском как инновационный проект. Особенности взаимодействия и консультирования | 4 |

| | | | |
|---|----------------------------------|--|---|
| | | заинтересованных сторон по вопросам управления предпринимательскими рисками с целью устойчивого развития организации | |
| 6 | Типичные ошибки риск-менеджмента | Типичные ошибки профессиональной деятельности руководства в сфере управления отдельными видами рисков. Многозначность (нечёткость) определений и понятий. Отсутствие комплекса стандартов РФ и ошибки перевода зарубежных стандартов риск-менеджмента. Противоречивые понятия (спекулятивный риск). Ошибки идентификации. Ошибки эксплуатации. | 5 |

5.2.2 Практические занятия (семинары)

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Тематика практических занятий (семинаров) | Трудоемкость, ак. ч |
|-------|--|---|---------------------|
| 1 | Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента | Основные определения и понятия риск-менеджмента. Принципы, цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации. Организация риск-менеджмента. Угрозы и опасности. | 2 |
| 2 | Управление рисками, как система менеджмента | Концепция, цели и задачи системы управления рисками. Система управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации. Методы управления рисками. Методы уклонения от риска. | 2 |
| 3 | Система управления риском. Анализ, управление, контроллинг | Анализ рисков. Реагирование на риск. Воздействие на риск. Информация и коммуникации. Контроллинг. Основные этапы процесса управления рисками. Анализ и оценка предпринимательской среды организации с целью разработки предложений по снижению рисков | 4 |
| 4 | Внутренний контроль и управление рисками корпораций | Понятие внутреннего контроля. Принципы системы внутреннего контроля и риск менеджмента, способствующие получению оптимального результата деятельности организации. Создание системы внутреннего контроля и риск-менеджмента. Взаимосвязанные компоненты, обеспечивающие эффективное управление рисками в компании. Оценка рыночных возможностей и угроз с точки зрения стратегии развития компании. | 2 |
| 5 | Риск-менеджмент в инвестиционной стратегии | Инвестиционная деятельность. Этапы инвестиционной деятельности. Инвестиционное проектирование и риск. Этапы исследования риска в процессе создания инновации. Система управления риском как инновационный проект. Особенности взаимодействия и консультирования заинтересованных сторон по вопросам управления предпринимательскими рисками с целью устойчивого развития организации | 4 |
| 6 | Типичные ошибки риск-менеджмента | Типичные ошибки профессиональной деятельности руководства в сфере управления отдельными видами рисков. Многозначность (нечёткость) определений и понятий. Отсутствие комплекса стандартов РФ и ошибки перевода зарубежных стандартов риск-менеджмента. Противоречивые понятия (спекулятивный риск). Ошибки идентификации. Ошибки эксплуатации. | 5 |

5.2.3 Лабораторный практикум не предусмотрен

5.2.4 Самостоятельная работа обучающихся

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Вид СРО | Трудоемкость, ак. ч |
|-------|--|---|---------------------|
| 1 | Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента | Проработка материалов по лекциям, учебникам, учебным пособиям | 1,5 |
| | | Подготовка к практическим/лабораторным занятиям ^к | 1,5 |
| | | Другие виды СРО | 7 |
| 2 | Управление рисками, как система менеджмента | Проработка материалов по лекциям, учебникам, учебным пособиям | 1,5 |
| | | Подготовка к практическим/лабораторным занятиям | 1,5 |
| | | Другие виды СРО | 7 |
| 3 | Система управления риском. Анализ, управление, контроллинг | Проработка материалов по лекциям, учебникам, учебным пособиям | 1,5 |
| | | Подготовка к практическим/лабораторным занятиям ^к | 1,5 |
| | | РПР | 10 |
| | | Другие виды СРО | 2 |
| 4 | Риск-менеджмент инвестиционной стратегии ^в | Проработка материалов по лекциям, учебникам, учебным пособиям | 1 |
| | | Подготовка к практическим/лабораторным занятиям ^к | 1,5 |
| | | Другие виды СРО | 8 |
| 5 | Типичные ошибки риск-менеджмента | Проработка материалов по лекциям, учебникам, учебным пособиям | 1 |
| | | Подготовка к практическим/лабораторным занятиям ^к | 1,5 |
| | | Другие виды СРО | 7,95 |
| 6 | Внутренний контроль и управление рисками корпораций | Проработка материалов по лекциям, учебникам, учебным пособиям | 3 |
| | | Подготовка к практическим/лабораторным занятиям ^к | 2 |
| | | Другие виды СРО | 8 |

6 Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

Для освоения дисциплины обучающийся может использовать:

6.1 Основная литература

Динец, Д. А. Теория и методология анализа рисков : учебное пособие / Д. А. Динец. — Иркутск : ИрГУПС, 2017. — 108 с. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/134666>

Зиновьев, В. Е. Управление рисками : учебное пособие / В. Е. Зиновьев. — Ростов-на-Дону : РГУПС, 2019. — 67 с. — ISBN 978-5-88814-929-4. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/159394>

Корабейников, И. Н. Риск-менеджмент : учебное пособие / И. Н. Корабейников. — Оренбург : ОГУ, 2019. — 172 с. — ISBN 978-5-7410-2353-2. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/160057>

Фомин, А. И. Управление рисками : учебное пособие / А. И. Фомин. — Кемерово : КузГТУ имени Т.Ф. Горбачева, 2018. — 142 с. — ISBN 978-5-00137-008-6. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/115178>

6.2 Дополнительная литература

Динец, Д. А. Теория и методология анализа рисков : методические указания / Д. А. Динец. — Иркутск : ИрГУПС, 2017. — 16 с. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/134665>

Слесарев, Д. Ю. Оценка риска и теория принятия решений : учебное пособие / Д. Ю. Слесарев. — Тольятти : ТГУ, 2012. — 83 с. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/139698>

Слесарев, Д. Ю. Оценка риска и теория принятия решений¹ : практикум / Д. Ю. Слесарев. — Тольятти : ТГУ, 2012. — 43 с. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/140258>

Анализ и оценка рисков : методические указания / составитель Е. В. Савенкова. — Москва : МПГУ, 2018. — 24 с. — ISBN 978-5-4263-0652-3. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/122348>

Охотников, И. В. Управление рисками : учебно-методическое пособие / И. В. Охотников, И. В. Сибирко. — Москва : РУТ (МИИТ), 2018. — 76 с. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система. — URL: <https://e.lanbook.com/book/173755>

6.3 Учебно-методические материалы

Корпоративные системы риск-менеджмента [Электронный ресурс]: задания для самостоятельной работы студентов для студентов, обучающихся по направлению 38.04.02 – «Менеджмент», очной формы обучения / Е. И. Кривенко [и др.] ; ВГУИТ, Кафедра управления, организации производства и отраслевой экономики. - Воронеж : ВГУИТ, 2021. - 24 с.

6.4 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля)

1. Министерство науки и высшего образования Российской Федерации (<https://minobrnauki.gov.ru/>)

2. Федеральная служба по надзору в сфере образования и науки (<http://obrnadzor.gov.ru/>)

3. Федеральный портал «Российское образование» (<http://www.edu.ru>)

4. Информационная система «Единое окно доступа к образовательным ресурсам» (<http://window.edu.ru>)

5. Федеральный центр информационно-образовательных ресурсов (<http://fcior.edu.ru/>)

6. ЭБС «Лань» <https://e.lanbook.com/>, неограниченный доступ. ООО «Издательство Лань» Лицензионный договор на предоставление права использования программного обеспечения ИКЗ 211366602677636660100100470016311244 № 883 от 20.12.2021 (срок действия с 03.03.2022 по 02.03.2023).

7. ЭБС «Лань» <https://e.lanbook.com/>, неограниченный доступ. ООО «ЭБС ЛАНЬ» Договор № 882 ИКЗ 211366602677636660100100480016311244 от 26.02.2021 (срок действия с 03.03.2022 по 02.03.2023).

8. ЭБС «Университетская библиотека онлайн» <https://biblioclub.ru/>, для 7000 пользователей. Базовая коллекция. ООО «Некс Медиа» Контракт об оказании информационных услуг № 102 ИКЗ 21136660267763666010010014000000244 от 21.02.2022 (срок действия с 01.03.2022 по 31.08.2022).

9. «Образовательная платформа ЮРАЙТ» <https://www.biblio-online.ru/> ООО Электронное издательство ЮРАЙТ. Договор на оказание услуг по предоставлению доступа к образовательной платформе № 707 от 09.11.2021 (срок действия с 03.12.2021 по 02.12.2022)

10. БД «ПОЛПРЕД Справочники» <http://www.polpred.com>, неограниченный доступ, ООО «ПОЛПРЕД Справочники» Соглашение № 128 от 12.04.2017 (скан-копия), (срок действия с 12.04.2017 до 15.10.2022)

11. Сетевая локальная БД Справочная Правовая Система Консультант Плюс для 50 пользователей, ООО «Консультант-Эксперт» Договор № 200016222100052 от 19.11.2021 (срок действия с 01.01.2022 по 31.01.2023)

12. Научная электронная библиотека <http://elibrary.ru/> ООО Научная электронная библиотека. Лицензионное соглашение № 681/633 от 04.09.2013, неограниченный доступ

13. Сводный каталог библиотек г. Воронеж https://lib.vsu.ru/zgate?init+lib_svkatalog.xml,simple_sv.xsl+rus, ФГБОУ ВО «ВГУ» Договор о безвозмездной передаче научно-технической продукции № 271 от 04.06.2018, неограниченный доступ (срок действия с 04.06.2018 по 03.06.2023)

14. ИС ЭКБСОН <http://www.vlibrary.ru/> ФГБУ «Государственная публичная научно-техническая библиотека России. Соглашение о сотрудничестве в области развития Информационной системы доступа к электронным каталогам библиотек сферы образования и

науки в рамках единого интернет-ресурса № 478 от 31.08.2020 г., неограниченный доступ (срок действия с 31.08.2020 по 31.08.2022).

6.5 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Microsoft Windows 7 (Microsoft Open License Microsoft Windows Professional 7 Russian Upgrade Academic OPEN 1 License No Level#47881748 от 24.12.2010 г. <http://eopen.microsoft.com>),

Альт Образование 8.2 + Liber Office 6.2 (Лицензия № AAA.0217.00 с 21.12.2017 г. по «Бессрочно»),

Adobe Reader XI ((бесплатное ПО) <https://acrobat.adobe.com/ru/ru/acrobat/pdf-reader/volume-distribution.html>),

Microsoft Office Professional Plus 2010 (Microsoft Open License Microsoft Office Professional Plus 2010 Russian Academic OPEN 1 License No Level #48516271 от 17.05.2011 г. <http://eopen.microsoft.com>),

Автоматизированная интегрированная библиотечная система «МегаПро» (Номер лицензии: 104-2015 Дата: 28.04.2015 Договор №2140 от 08.04.2015 г. Уровень лицензии «Стандарт»)

7 Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля)

| | |
|--|---|
| <p>Учебная аудитория для проведения учебных занятий (2 ауд.) Комплект мебели для учебного процесса. Проектор Epson EB-W9 2500 Переносное оборудование, экран, ноутбук Lenovo, акустическая система BEHRINGER B208D; Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий, обеспечивающие тематические иллюстрации</p> | <p>394036, Воронежская область, г. Воронеж, Центральный район, проспект Революции, 19 № 28, 2 этаж (Административный корпус)</p> |
| <p>Учебная аудитория для проведения учебных занятий (ауд. 248) Комплект мебели для учебного процесса. Мультимедийное оборудование: Компьютер ASUS; Коммутатор D-Link DES-1008D; Принтер HP LaserJet 1018; Интерактивная доска Activboard; переносные колонки активные Microlab SOLO.</p> | <p>394036, Воронежская область, г. Воронеж, Центральный район, проспект Революции, 19 № 9, 2 этаж (Административный корпус)</p> |
| <p>Учебная аудитория (помещение для самостоятельной работы обучающихся) (ауд. 427 а) Комплект мебели для учебного процесса. Компьютер Intel Core Duo E5300, сетевой коммутатор для подключения к компьютерной сети (Интернет), ноутбук Lenovo, ноутбук Asus D541NAGQ335T, ноутбук Samsung 300Ci5-241OM 2.3, ноутбук HP AMD, ноутбук Acer "17.3" Celeron N 3350/1, 1/2048/500/Intel/HD/WIN10, ноутбук DNS, Ноутбук Acer 15.6.</p> | <p>394036, Воронежская область, г. Воронеж, Центральный район, проспект Революции, 19 № 71, 4 этаж ЛИТЕРА 1Е</p> |

8 Оценочные материалы для промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю)

Оценочные материалы (ОМ) для дисциплины (модуля) включают в себя:

- перечень компетенций с указанием индикаторов достижения компетенций, этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы;
- описание шкал оценивания;
- типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков;
- методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности.

ОМ представляются отдельным комплектом и **входят в состав рабочей программы дисциплины (модуля)**.

Оценочные материалы формируются в соответствии с П ВГУИТ «Положение об оценочных материалах».

ПРИЛОЖЕНИЕ
к рабочей программе

КОРПОРАТИВНЫЕ СИСТЕМЫ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА

1. Организационно-методические данные дисциплины для заочной формы обучения

1.1 Объемы различных форм учебной работы и виды контроля в соответствии с учебным планом

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 3 зачетные единицы

| Виды учебной работы | Всего академических часов, ак.ч | Распределение трудоемкости по семестрам, ак.ч |
|---|---------------------------------|---|
| | | 3 семестр |
| Общая трудоемкость дисциплины (модуля) | 108,00 | 108,00 |
| Контактная работа в т. ч. аудиторные занятия: | 18,10 | 18,10 |
| Лекции | 8,00 | 8,00 |
| <i>в том числе в форме практической подготовки</i> | 8,00 | 8,00 |
| Практические/лабораторные занятия | 8,00 | 8,00 |
| <i>в том числе в форме практической подготовки</i> | 8,00 | 8,00 |
| Консультации текущие | 1,2 | 1,2 |
| Рецензирование контрольных работ обучающихся-заочников | 0,8 | 0,8 |
| Вид аттестации (зачет) | 0,1 | 0,1 |
| Самостоятельная работа: | 86,00 | 86,00 |
| Проработка материалов по лекциям, учебникам, учебным пособиям | 4,00 | 4,00 |
| Подготовка к практическим занятиям | 4,00 | 4,00 |
| Контрольная работа | 10,00 | 10,00 |
| Другие виды самостоятельной работы | 68,00 | 68,00 |
| Подготовка к зачету (контроль) | 3,90 | 3,90 |

**ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ
ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ**

по дисциплине

КОРПОРАТИВНЫЕ СИСТЕМЫ РИСК - МЕНЕДЖМЕНТА

1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования

| № п/п | Код компетенции | Формулировка компетенции | Код и наименование индикатора достижения компетенции |
|-------|-----------------|---|---|
| 1 | ПКв-1 | Способен планировать, координировать и обеспечивать интегрированную комплексную деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации | ИД1 _{ПКв-1} - Использует принципы, определяет цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации в соответствии со стратегическими целями организации |
| | | | ИД2 _{ПКв-1} - Планирует, контролирует и осуществляет профессиональную деятельность в сфере управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации |
| 1 | ПКв-2 | Способен давать рекомендации и обеспечивать взаимодействие между заинтересованными сторонами по вопросам управления рисками с целью устойчивого развития организации | ИД1 _{ПКв-2} – Изучает, анализирует и оценивает предпринимательскую среду организации с целью разработки предложений по снижению рисков |
| | | | ИД2 _{ПКв-2} – Обеспечивает взаимодействие и консультирование заинтересованных сторон по вопросам управления предпринимательскими рисками с целью устойчивого развития организации |

| Код и наименование индикатора достижения компетенции | Результаты обучения (показатели оценивания) |
|---|---|
| ПКв-1 - Способен планировать, координировать и обеспечивать интегрированную комплексную деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации | |
| ИД1 _{ПКв-1} - Использует принципы, определяет цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации в соответствии со стратегическими целями организации | Знает: Принципы построения систем управления рисками |
| | Умеет: Организовывать процесс управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов |
| | Имеет навыки: Использования принципов построения системы управления рисками в обеспечении деятельности организации |
| ИД2 _{ПКв-1} - Планирует, контролирует и осуществляет профессиональную деятельность в сфере управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации | Знает: Полномочия и обязательства менеджмента по реализации плана управления рисками |
| | Умеет: Разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками |
| | Имеет навыки: Коммуникации и консультации с заинтересованными сторонами на всех стадиях процесса управления рисками |
| ПКв-2 - Способен давать рекомендации и обеспечивать взаимодействие между заинтересованными сторонами по вопросам управления рисками с целью устойчивого развития организации | |
| ИД1 _{ПКв-2} – Изучает, анализирует и оценивает предпринимательскую среду организации с целью разработки предложений по снижению рисков | Знает: Основные методологии управления рисками |
| | Умеет: Анализировать корпоративные нормативные акты, информацию о порядке и особенностях выполнения действий по управлению рисками и эффективность выполнения этих действий |
| | Имеет навыки: Согласования методологий по управлению рисками в организации |
| ИД2 _{ПКв-2} – Обеспечивает взаимодействие и консультирование заинтересованных сторон по | Знает: основы управления проектами |
| | Умеет: Применять стандарты в области риск-менеджмента и лучшие практики в области создания и |

| | | |
|--|-------------------------------------|--|
| вопросам предпринимательскими целью устойчивого организации | управления рисками с развития | поддержания культуры управления рисками в организации |
| | | Имеет навыки: Реализации специальных проектов по управлению рисками по запросу руководства |

2 Паспорт оценочных материалов по дисциплине/практике

| № п/п | Разделы дисциплины | Индекс контролируемой компетенции (или ее части) | Оценочные средства | | Технология/процедура оценивания (способ контроля) |
|-------|--|---|---|------------|---|
| | | | Наименование | №№ заданий | |
| 1 | Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента | ПКв-1 (ИД1 _{ПКв-1} , ИД2 _{ПКв-1}), ПКв-2 (ИД1 _{ПКв-2} , ИД2 _{ПКв-2}) | Собеседование (вопросы к зачету к экзамену) | 1-120 | Уровневая шкала |
| 2 | Управление рисками, как система менеджмента | | Тест | | Процентная шкала |
| 3 | Система управления риском. Анализ, управление, контроллинг | | Собеседование (решение практических задач) | | Уровневая шкала |
| 4 | Внутренний контроль и управление рисками корпораций | | Кейс-задания (ситуационные задания) | | Уровневая шкала |
| 5 | Риск-менеджмент в инвестиционной стратегии | | РПР | | Уровневая шкала |
| 6 | Типичные ошибки риск-менеджмента | | | | |

3 Оценочные материалы для промежуточной аттестации.

Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

Аттестация обучающегося по дисциплине/практике проводится в форме тестирования и предусматривает возможность последующего собеседования (экзамена).

3.1. Банк заданий

Шифр и наименование компетенции

ПКв-1 Способен планировать, координировать и обеспечивать интегрированную комплексную деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации (ИД1ПКв-1 - Использует принципы, определяет цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации в соответствии со стратегическими целями организации)

| | |
|-----------|--|
| № задания | Тестовое задание с выбором одного правильного ответа |
| 1 | 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 |
| 2 | Определите, что подразумевается под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков: а) страховой тариф; б) страховая сумма; в) страховая премия. |
| 3 | Риски по уровню финансовых потерь делятся на: а) допустимый, критический и катастрофический; б) недопустимый, допустимый и критический; в) критический, катастрофический и недопустимый. |
| 4 | Вид риска, к которому относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент: а) экономический б) предпринимательский в) политический |
| 5 | Подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных спецификой климатических условий, а также наличием природных ресурсов: а) природно-климатические б) антропогенные в) социально-бытовые |
| 6 | Укажите, чем измеряется величина или степень риска: а) средним ожидаемым значение б) изменчивостью возможного результата в) оба варианта верны |
| 7 | Социально-экономическая функция риска состоит в следующем: а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике – отрасли деятельности, в которых риск приемлем б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода в) оба варианта верны |
| 8 | Выделите метод оценки риска, используемый в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий: а) имитационное моделирование б) вероятностный метод в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости г) построение дерева решений д) анализ чувствительности е) метод сценариев |
| 9 | Отметьте метод оценки риска, представляющий собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты: а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости б) анализ чувствительности в) построение дерева решений г) вероятностный метод д) метод сценариев е) имитационное моделирование |
| 10 | Субъект управления в риск-менеджменте это: а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками б) все варианты верны в) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами |
| 11 | Объектом управления в риск-менеджменте выступает: 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 |

| 12 | «Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» – в чем смысл этой фразы? а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов б) закона неизбежности риска в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод | | | | | | | | | | |
|--|--|-----------------------------------|---|----------------------------|--|------------------------------|---|-------------------------------|---|------------------------------------|---|
| 13 | Выберите методы, к которым относится обучение и инструктирование персонала: а) методы уклонения от рисков б) методы компенсации рисков в) методы диверсификации рисков г) методы локализации рисков | | | | | | | | | | |
| Тестовые вопросы с выбором нескольких вариантов ответа (с указанием количества правильных ответов) | | | | | | | | | | | |
| 14 | Методы снижения риска: А) снижение частоты ущерба или предотвращение убытков; Б) уменьшение размера убытков; В) разделение риска (диверсификация и дублирование и др.); Г) покрытие убытка на основе самострахования; Д) дерево решений | | | | | | | | | | |
| 15 | Методы передачи риска: А) страхование; Б) передача ответственности по договору; В) создание совместного предприятия; Г) покрытие убытка на основе поддержки государственных и муниципальных органов; Д) уменьшение размера убытка. | | | | | | | | | | |
| 16 | Контроллинг – инструмент сбора информации, учета, анализа и внесения изменений – входит в процесс управления рисками и включает в себя: А) мониторинг управления рисками; В) анализ управления рисками; Г) аудит и координацию управления рисками; Д) оценку эффективности управления рисками; Е) страхование | | | | | | | | | | |
| 17 | Каковы функции объекта управления в риск-менеджменте? А) организация разрешения риска; Б) организация рискованных вложений капитала; В) организация работы по снижению величины риска; Г) организация процесса страхования рисков; Д) организация экономических отношений и связей между субъектами хозяйственного процесса; Е) страхование риска. | | | | | | | | | | |
| 18 | На какие виды подразделяются финансовые риски? А) валютные; Б) инвестиционные; В) страховые | | | | | | | | | | |
| Тестовые вопросы на нахождение соответствия, выстраивание последовательности | | | | | | | | | | | |
| 19 | 1. Соотнесите процесс управления рисками: <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">а: 1 этап</td> <td style="width: 50%;">1 подготовка (планирования) мероприятий по управлению рисками</td> </tr> <tr> <td>б: 2 этап</td> <td>2: этап принятия решений</td> </tr> <tr> <td>в: 3 этап</td> <td>3 реализации запланированных и внеплановых мероприятий по управлению рисками</td> </tr> </table> <p style="text-align: center;">а- 1, б – 3, в – 2</p> | а: 1 этап | 1 подготовка (планирования) мероприятий по управлению рисками | б: 2 этап | 2: этап принятия решений | в: 3 этап | 3 реализации запланированных и внеплановых мероприятий по управлению рисками | | | | |
| а: 1 этап | 1 подготовка (планирования) мероприятий по управлению рисками | | | | | | | | | | |
| б: 2 этап | 2: этап принятия решений | | | | | | | | | | |
| в: 3 этап | 3 реализации запланированных и внеплановых мероприятий по управлению рисками | | | | | | | | | | |
| 20 | Сопоставьте определения зон (областей) риска: <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 50%;">Наименование зоны (области) риска</th> <th style="width: 50%;">Определение зоны (области) риска</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1. Зона минимального риска</td> <td>а) возможность потерь, превышающих расчетную прибыль вплоть до полной утраты выручки</td> </tr> <tr> <td>2. Область допустимого риска</td> <td>б) состояние, в котором вероятные потери могут достигать величины, равной стоимости имущества предприятия</td> </tr> <tr> <td>3. Область критического риска</td> <td>в) состояние предприятия, когда возможные незапланированные потери незначительны и маловероятны и вряд ли превысят чистую прибыль</td> </tr> <tr> <td>4. Область катастрофического риска</td> <td>г) состояние, когда вероятные потери находятся в пределах запланированной прибыли</td> </tr> </tbody> </table> <p style="text-align: center;">1-в, 2-г, 3-а, 4-б</p> | Наименование зоны (области) риска | Определение зоны (области) риска | 1. Зона минимального риска | а) возможность потерь, превышающих расчетную прибыль вплоть до полной утраты выручки | 2. Область допустимого риска | б) состояние, в котором вероятные потери могут достигать величины, равной стоимости имущества предприятия | 3. Область критического риска | в) состояние предприятия, когда возможные незапланированные потери незначительны и маловероятны и вряд ли превысят чистую прибыль | 4. Область катастрофического риска | г) состояние, когда вероятные потери находятся в пределах запланированной прибыли |
| Наименование зоны (области) риска | Определение зоны (области) риска | | | | | | | | | | |
| 1. Зона минимального риска | а) возможность потерь, превышающих расчетную прибыль вплоть до полной утраты выручки | | | | | | | | | | |
| 2. Область допустимого риска | б) состояние, в котором вероятные потери могут достигать величины, равной стоимости имущества предприятия | | | | | | | | | | |
| 3. Область критического риска | в) состояние предприятия, когда возможные незапланированные потери незначительны и маловероятны и вряд ли превысят чистую прибыль | | | | | | | | | | |
| 4. Область катастрофического риска | г) состояние, когда вероятные потери находятся в пределах запланированной прибыли | | | | | | | | | | |
| Задачи (задания) в 1-2 действия на разные формулы и процессы | | | | | | | | | | | |
| 21 | Задание 1 Торговый агент предлагает предприятиям новый продукт. Из предыдущего опыта ему известно, что в среднем 1 из 65 клиентов, которым он предлагает товар, покупает его. В течение некоторого промежутка времени он предложил продукт 20 предприятиям. Чему равна вероятность того, что он продаст им хотя бы единицу | | | | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|----------------------------------|---|--------------------------------|--|-----------------------------|--|----------------------------------|--|
| | <p>товара?</p> <p>Решение 1. определяем вероятность покупки продукта: $P(A) = 1 / 65 = 0,015$.</p> <p>2. Рассчитываем вероятность того, что торговый агент продаст хотя бы единицу товара 20 предприятиям: $P(BA) = 20 \cdot 0,015 = 0,3$.</p> <p>Ответ: вероятность того, что торговый агент продаст 20 предприятиям хотя бы единицу товара, равна 0,3.</p> | | | | | | |
| 22 | <p>Задание 2</p> <p>Для оплаты контракта на 10 тыс. у. е. организацией сделана заявка на кредит в трех банках: в первом на 6 тыс. у. е., во втором на 4 тыс. у. е., в третьем на 5 тыс. у. е. Вероятность получения кредита в каждом из банков соответственно равна 0,5; 0,8 и 0,6. Какова вероятность того, что полученной суммы денег будет достаточно для оплаты контракта?</p> <p>Решение Пусть вероятность события А ($P(A)$) – это вероятность того, что полученной суммы денег будет достаточно для оплаты контракта, тогда искомая вероятность находится следующим образом:</p> $P(A) = \frac{6}{10} \cdot 0,5 + \frac{4}{10} \cdot 0,8 + \frac{5}{10} \cdot 0,6 = 0,92.$ <p>Ответ: вероятность того, что полученной суммы средств будет достаточно для оплаты контракта, составляет 0,92.</p> | | | | | | |
| 23 | <p>Задание 3</p> <p>Определить коэффициент убыточности и коэффициент кумуляции объекта на одно страховое событие страховой организации, исходя из следующих показателей: число застрахованных объектов – 1800; число страховых событий – 87; число пострадавших объектов – 105; страховая сумма всех застрахованных объектов – 4120 тыс. у. е.; страховое возмещение – 54,2 тыс. у. е.; страховая премия – 57,8 тыс. у. е.</p> <p>Решение</p> <p>1. Рассчитываем коэффициент убыточности $K_u = 54,2 / 57,8 = 0,938$.</p> <p>2. Определяем коэффициент кумуляции риска объекта на одно страховое событие $K_k = 105 / 87 = 1,2$.</p> | | | | | | |
| | <p>Кейс-задания (Ситуационные задания)</p> | | | | | | |
| 24 | <p>Задание 1</p> <p>Определить основные относительные показатели страховой стати-стики страховой организации, исходя из следующих показателей: число застрахованных объектов – 1800; число страховых событий – 87; число пострадавших объектов – 105; страховая сумма всех застрахованных объектов – 4120 тыс. у. е.; страховое возмещение – 54,2 тыс. у. е.; страховая премия – 57,8 тыс. у. е.</p> <p>Решение</p> <p>1. Рассчитываем коэффициент убыточности $K_u = 54,2 / 57,8 = 0,938$.</p> <p>2. Определяем коэффициент кумуляции риска объекта на одно страховое событие $K_k = 105 / 87 = 1,2$.</p> <p>3. Рассчитываем вероятность наступления страхового случая $p = 105 : 1800 = 0,058$.</p> <p>4. Определяем коэффициент тяжести риска $K_{тр} = (54,2 : 105) : (4120 : 1800) = 0,225$.</p> | | | | | | |
| 25 | <p>Задание 2</p> <p>В какой форме выражены следующие виды неопределенности? Соотнесите формы неопределенности и представленные примеры. Выбранные ответы занесите в таблицу.</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">1. Вероятностное распределение</td> <td style="width: 40%;"></td> </tr> <tr> <td>2. Субъективная вероятность</td> <td></td> </tr> <tr> <td>3. Интервальная неопределенность</td> <td></td> </tr> </table> <p>А) После запуска рекламной кампании предприятие ожидает всплеска покупательского спроса на свою продукцию. В данном случае неизвестно, насколько повысится спрос, однако известны примерные сроки его повышения, полученные, например, путем анализа предыдущей рекламной кампании.</p> <p>Б) Предприятию известно, что в будущем году поставщики планируют повысить цену на продаваемую продукцию. Рост цены составит от 3 % до 6 % и зависит от конъюнктуры рынка.</p> <p>В) Предприятие наладило выпуск новой продукции. Руководство ожидает, что данная продукция будет пользоваться спросом, однако не имеет достоверных прогнозных данных, позволяющих с точностью утверждать, какой именно объем продукции будет реализован.</p> <p>Г) Предприятие ожидает значительного всплеска продаж производимой продукции в осенний сезон, однако точный объем продаж неизвестен.</p> <p>Д) По мнению сотрудников отдела стратегического развития, доля рынка, занимаемого предприятием, составляет 12 %, однако ее изменение в следующем году трудно прогнозировать.</p> <p>Е) После повышения цены на реализуемую продукцию эксперты могут прогнозировать снижение спроса на нее, однако неизвестно, насколько он снизится.</p> <p>Ответ: 1- А, Б; 2- В; 3 – Г, Д.</p> | 1. Вероятностное распределение | | 2. Субъективная вероятность | | 3. Интервальная неопределенность | |
| 1. Вероятностное распределение | | | | | | | |
| 2. Субъективная вероятность | | | | | | | |
| 3. Интервальная неопределенность | | | | | | | |

Шифр и наименование компетенции

ПКв-1 Способен планировать, координировать и обеспечивать интегрированную комплексную деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации (ИД2ПКв-1 - Планирует, контролирует и осуществляет профессиональную деятельность в сфере управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации)

| № задания | Тестовое задание с выбором одного правильного ответа |
|-----------|--|
| 26 | Дайте определение термину «риск»: 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 |
| 27 | Что из перечисленного относится к потерям времени? а) невыполнение сроков сдачи объекта б) потери ценных бумаг в) выплата штрафа г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию д) уплата дополнительных налогов |
| 28 | Процесс использования механизмов уменьшения рисков называется так: а) диверсификация б) лимитирование в) хеджирование |
| 29 | Анализ риска подразумевает под собой следующее: 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 |
| 30 | Выберите, что является принципом действия механизма диверсификации: а) избежание рисков; б) разделение рисков; в) снижение рисков. |
| 31 | К этим методам относится распределение ответственности между участниками проекта: а) методы диверсификации рисков б) методы компенсации рисков в) методы локализации рисков г) методы уклонения от рисков |
| 32 | Выберите подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных техногенными катастрофами: а) антропогенные б) природно-климатические в) социально-бытовые |
| 33 | Отметьте подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных заболеваемостью животных и людей инфекционными заболеваниями: а) природно-климатические б) социально-бытовые в) антропогенные |
| 34 | Укажите группу методов управления экологическими рисками, к которой относится введение нормативных стандартов и ограничений для производителей: а) распределение прав на загрязнение б) административное регулирование в) система платежей и налогов за экологические загрязнения г) создание экономических стимулов |
| 35 | Как называется контракт, который дает право купить определенное количество базового актива по оговоренной цене и в определенный срок? а) опционом пут б) фьючерсным контрактом в) опционом колл г) форвардным контрактом |

| | | | | | | | |
|--|---|------------------|---|-------------------|--|---------------------------------|---|
| 36 | К каким методам относится прогнозирование внешней обстановки? а) методы компенсации рисков б) методы уклонения от рисков в) методы локализации рисков г) методы диверсификации рисков | | | | | | |
| 37 | К каким методам относится распределение риска по этапам работы? а) методы локализации рисков б) методы компенсации рисков в) методы уклонения от рисков г) методы диверсификации рисков | | | | | | |
| 38 | Выберите, к каким методам относится заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов: а) методы диверсификации рисков б) методы уклонения от рисков в) методы компенсации рисков г) методы локализации рисков | | | | | | |
| 39 | Название риска, который не зависит от состояния рынка и является спецификой конкретной организации: а) чистый б) спекулятивный в) несистемный г) системный | | | | | | |
| 40 | Название риска, связанного с изменениями, вызванными общерыночными колебаниями, и не зависящий от конкретного предприятия: а) чистый б) системный в) несистемный | | | | | | |
| Тестовые вопросы с выбором нескольких вариантов ответа (с указанием количества правильных ответов) | | | | | | | |
| 41 | Какие из перечисленных источников могут использоваться для информационного обеспечения риск-менеджмента? А) контракты, договоры об имущественных сделках; Б) кредитные договоры; В) бухгалтерская отчетность; Г) статистическая отчетность. Д) журналы, газеты | | | | | | |
| 42 | Метод покрытия убытков из текущих доходов используют, если: А) величина убытков не велика; Б) это не искажает денежных потоков; В) преобладают угрозы над сильными сторонами и возможностями | | | | | | |
| 43 | К финансовым рискам при лизинговой деятельности относят: А) риск производителя; Б) риск кредитующего лизингодателя; В) риск страхователя | | | | | | |
| 44 | При получении банковского кредита под инвестиционную программу могут возникнуть риски: А) недостаточной рентабельности вкладываемого капитала; Б) несвоевременности возврата заемных средств в условиях неопределенности;- В) ошибки расчета периода окупаемости инвестиционного проекта; Г) нет правильного ответа | | | | | | |
| Тестовые вопросы на нахождение соответствия, выстраивание последовательности | | | | | | | |
| 45 | 1. Соотнесите понятия с определениями: <table border="1" data-bbox="264 1518 1524 1742"> <tr> <td>А Передача риска</td> <td>1 перенесение всего или части риска на другое лицо (сторону). Примером является заключение договора страхования, в соответствии с которым определённый риск передаётся от страхователя страховщику.</td> </tr> <tr> <td>Б Удержание риска</td> <td>2 процесс, направленный на уменьшение негативных последствий риска и их соответствующих вероятностей. Если снижение вероятности проводится только до события</td> </tr> <tr> <td>В Снижение риска</td> <td>3 принятие всего или части риска вместо использования для этой цели страхования или иной формы передачи риска</td> </tr> </table> <p style="text-align: center;">а - 1, б - 3, в - 2</p> | А Передача риска | 1 перенесение всего или части риска на другое лицо (сторону). Примером является заключение договора страхования, в соответствии с которым определённый риск передаётся от страхователя страховщику. | Б Удержание риска | 2 процесс, направленный на уменьшение негативных последствий риска и их соответствующих вероятностей. Если снижение вероятности проводится только до события | В Снижение риска | 3 принятие всего или части риска вместо использования для этой цели страхования или иной формы передачи риска |
| А Передача риска | 1 перенесение всего или части риска на другое лицо (сторону). Примером является заключение договора страхования, в соответствии с которым определённый риск передаётся от страхователя страховщику. | | | | | | |
| Б Удержание риска | 2 процесс, направленный на уменьшение негативных последствий риска и их соответствующих вероятностей. Если снижение вероятности проводится только до события | | | | | | |
| В Снижение риска | 3 принятие всего или части риска вместо использования для этой цели страхования или иной формы передачи риска | | | | | | |
| 46 | Сопоставьте риски и определения: <table border="1" data-bbox="264 1827 1481 1998"> <tr> <td>1. Финансовые</td> <td>А) связанные с невозвратом средств или их части со стороны клиентов, заемщиков и т.п.</td> </tr> <tr> <td>2. Политические</td> <td>Б) связанные с деятельностью поставщиков или собственного персонала.</td> </tr> <tr> <td>3. Производственные (проектные)</td> <td>В) связанные с изменением позиции государственных органов и общественных организаций всех уровней.</td> </tr> </table> <p style="text-align: center;">1-А, 2-В, 3-Б</p> | 1. Финансовые | А) связанные с невозвратом средств или их части со стороны клиентов, заемщиков и т.п. | 2. Политические | Б) связанные с деятельностью поставщиков или собственного персонала. | 3. Производственные (проектные) | В) связанные с изменением позиции государственных органов и общественных организаций всех уровней. |
| 1. Финансовые | А) связанные с невозвратом средств или их части со стороны клиентов, заемщиков и т.п. | | | | | | |
| 2. Политические | Б) связанные с деятельностью поставщиков или собственного персонала. | | | | | | |
| 3. Производственные (проектные) | В) связанные с изменением позиции государственных органов и общественных организаций всех уровней. | | | | | | |
| Задачи (задания) в 1-2 действия на разные формулы и процессы | | | | | | | |

| 47 | <p>Задание 1 Имеются два варианта вложения одной и той же суммы капитала. При первом варианте капитал совершает за год 20 оборотов, рентабельность произведенного и реализованного товара 20 %. По второму варианту капитала совершает за год 26 оборотов, рентабельность произведенного и реализованного товара 18 %. Выбор эффективного варианта вложения капитала производится по критерию – максимум нормы прибыли на вложенный капитал.</p> <p>Решение Рентабельность капитала R_k по вариантам: – первый: $R_k = 20 \times 20 / 100 = 4 \%$. – второй: $R_k = 26 \times 18 / 100 = 4,68 \%$. Выбираем второй вариант как более рентабельный.</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|----------------------------|--|--------|---------|-----------------|--|----------------------------|--|--------------------|--|---------------|--|--------------|--|-----------------------|--|---------------------|--|-----------------|--|
| | <p>Кейс-задания (Ситуационные задания)</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 48 | <p>Задание 1 Риск – это, по сути, обратная сторона свободы предпринимательства. Предпринимательства без риска не бывает, и наибольшую прибыль, как правило, приносят операции с повышенным риском. Уровень криминогенных рисков в первую очередь зависит от степени криминализации региона, на территории которого организация осуществляет свою деятельность. Вопросы 1. Необходимо ли, по Вашему мнению, учитывать криминогенные риски при принятии управленческих решений?</p> <p>Ответ: учитывать криминогенные риски необходимо для выявления их на территории с более или менее острой криминогенной обстановкой, что может иметь существенное значение при принятии управленческих решений, касающихся размещения долгосрочных капиталовложений или открытия дочерних предприятий в ходе диверсификации бизнеса.</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 49 | <p>Задание 2</p> <p>Российский инвестор купил акции компании А на 357,143 тыс. долларов. Стандартное отклонение доходности акции составляет 1,58 %. Курс доллара 1 доллар = 70 руб., стандартное отклонение валютного курса в расчете на один день 0,6 %, коэффициент корреляции между курсом доллара и ценой акции компании А равен 0,2. Определить VaR портфеля инвестора с доверительной вероятностью 98%.</p> <p>Решение Рублевый эквивалент инвестора составит: $357143 \cdot 70 = 25000010$ руб. = 25 млн. руб. – инвестор рискует суммой в 25 млн. руб., риск обусловлен возможным падением котировок акций компании А и падением курса доллара. При возникновении любого из рисков стоимость портфеля будет ниже 25 млн. руб.</p> $\sigma_p^2 = 1,58^2 + 0,6^2 + 2 \cdot 1,58 \cdot 0,6 \cdot 0,2 = 3,2356.$ <p>Стандартное отклонение доходности составляет</p> $\sigma_p = \sqrt{3,2356} = 1,7988\%.$ <p>Однодневный VaR портфеля равен</p> $10 \text{ млн} \cdot 0,017988 \cdot 1,65 = 296,8 \text{ тыс. руб.}$ | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 50 | <p>Задание 3 Распределить следующие факторы риска по группам: 1) стихийные бедствия; 2) внедрение инноваций; 3) повышение налоговых ставок; 4) выборы; 5) легкость вхождения в отрасль; 6) уровень безработицы; 7) особенности технологического процесса; 8) степень конкуренции.</p> <table border="1" data-bbox="264 1798 1516 2051"> <thead> <tr> <th>Группа</th> <th>Факторы</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>А) Политические</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Б) Социально-экономические</td> <td></td> </tr> <tr> <td>В) Законодательные</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Г) Отраслевые</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Д) Природные</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Е) Научно-технические</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Ж) Производственные</td> <td></td> </tr> <tr> <td>З) Коммерческие</td> <td></td> </tr> </tbody> </table> | Группа | Факторы | А) Политические | | Б) Социально-экономические | | В) Законодательные | | Г) Отраслевые | | Д) Природные | | Е) Научно-технические | | Ж) Производственные | | З) Коммерческие | |
| Группа | Факторы | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| А) Политические | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Б) Социально-экономические | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| В) Законодательные | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Г) Отраслевые | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Д) Природные | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Е) Научно-технические | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| Ж) Производственные | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| З) Коммерческие | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

ПКв-2 Способен давать рекомендации и обеспечивать взаимодействие между заинтересованными сторонами по вопросам управления рисками с целью устойчивого развития организации (ИД1ПКв-2 – Изучает, анализирует и оценивает предпринимательскую среду организации с целью разработки предложений по снижению рисков)

| № задания | Тестовое задание с выбором одного правильного ответа |
|-----------|--|
| 51 | Величина возможных колебаний прибыли была впервые названа критерием риска представителями... а) Классической теории предпринимательского риска; б) Неоклассической школы риска; в) Кейнсианской научной школы. |
| 52 | Объективная вероятность наступления рискового события... А. Основана на предположении о возможности получения определенного эффекта; Б. Базируется на расчете частоты, с которой происходит процесс или явление. |
| 53 | Назовите основные причины, ограничивающие практическое применение статистических данных для определения вероятностей наступления событий А. Недостаточный объем статистических данных или их отсутствие; Б. Влияние субъективных особенностей исследователя; В. Наличие неопределенности в реальных условиях предпринимательской деятельности. |
| 54 | С чем связано возникновение социальной неопределенности при принятии рисковых решений? А. С влиянием личностных характеристик руководителя и исполнителей; Б. С неопределенностью внешней среды; В. С возникновением различных социальных связей и коммуникаций при реализации решений. |
| 55 | Как соотносятся понятие «неопределенность» и понятие «риск»? А. В реальной предпринимательской деятельности эти понятия являются синонимами; Б. Риск характеризует такую ситуацию, когда наступление некоторых событий может быть оценено количественно, а неопределенность предполагает невозможность оценки вероятности наступления таких событий; В. Неопределенность характеризует условия внешней среды, а риск – действия предпринимателя, поэтому эти понятия не связаны. |
| 56 | В чем состоит регулятивная функция риска? А. В необходимости идентификации, оценки, управления риском по всем направлениям деятельности организации; Б. В необходимости затрат на возмещение ущерба в случае наступления рискового события. |
| 57 | Деловая активность предприятия, маркетинговая стратегия, политика в области управления персоналом, производственный потенциал выступают А. Внешними факторами риска; Б. Внутренними факторами риска. |
| 58 | Спекулятивные (динамические, коммерческие) риски - А. Всегда несут потери для предпринимательской деятельности; Б. Могут нести как потери, так и дополнительную прибыль; В. Характеризуют дополнительные возможности получения прибыли. |
| 59 | Изменение курса валют, конъюнктуры рынка, налогового законодательства выступают факторами... А. Чистых рисков; Б. Спекулятивных рисков. |
| 60 | Риск убытков, связанных с неэффективным использованием предприятием основных и оборотных средств, относится к: А. Коммерческому риску; Б. Производственному риску; В. Финансовому риску; Г. Страховому риску. |
| 61 | К рисками, связанным с покупательной способностью денег, относятся: А. Риски ликвидности, валютные, дефляционные, инфляционные риски; Б. Риск снижения доходности, риск прямых финансовых потерь, риск упущенной выгоды; В. Инвестиционные и финансовые риски. |
| 62 | Кредитный риск представляет собой: А. Опасность потерь коммерческими банками, кредитными учреждениями, инвестиционными |

| | | | | | | | |
|---|---|---|--|---------------------------------|---|---------------------------------|---|
| | институтами в результате превышения процентных ставок, выплачиваемых ими по привлеченным средствам, над ставками по предоставленным кредитам; Б. Риск неплатежа по коммерческим сделкам и риск недополучения комиссионного вознаграждения; В. Опасность неуплаты заемщиком основного долга и процентов. | | | | | | |
| 63 | Риск неправильного выбора видов вложения капитала, вида ценных бумаг для инвестирования в сравнении с другими видами ценных бумаг при формировании инвестиционного портфеля представляет собой: А. Селективный риск; Б. Биржевой риск; В. Деловой риск; Г. Кредитный риск. | | | | | | |
| 64 | Риски, вызванные ошибками менеджмента компании (в том числе и при принятии решений), ее сотрудников; проблемами системы внутреннего контроля, плохо разработанными правилами работ относятся к: А. Деловым рискам; Б. Организационным рискам; В. Юридическим рискам; Г. Менеджерским рискам. | | | | | | |
| 65 | Риск-проблема, возникающая в предпринимательской деятельности, представляет собой: А. Рассогласование между планируемой прибылью и реальными возможностями организации; Б. Влияние разнообразных рисков факторов на достижение целей организации; В. Недопустимо большое рассогласование между потребностью в безопасности и реальным уровнем риска в процессе предпринимательской деятельности. | | | | | | |
| 66 | Идентификация рисков представляет собой: А. Анализ существующих видов риска предпринимательской деятельности; Б. Оценку последствий рисков событий; В. Установление видов, источников рисков и знание природы их происхождения с учетом специфики деятельности организации. | | | | | | |
| 67 | Риски, последствия которых могут быть определены с высокой степенью достоверности и которые могут быть идентифицированы при анализе статистической или бухгалтерской отчетности относятся к: А. Известным рискам; Б. Предвидимым рисками; В. Непредвидимым рискам. | | | | | | |
| 68 | Количественным выражением того, что в результате принятого решения ожидаемый доход будет получен не в полном объеме или будут потеряны предпринимательские ресурсы, является: А. Фактор риска; Б. Показатель риска; В. Вид риска. | | | | | | |
| | Тестовые вопросы с выбором нескольких вариантов ответа (с указанием количества правильных ответов) | | | | | | |
| 69 | Защитная функция риска состоит: а) в том, что юридические и физические лица вынуждены искать средства и формы защиты от нежелательной реализации риска б) в объективной необходимости законодательного закрепления понятия «правомерности риска», правового регулирования страховой деятельности в) нет правильного ответа | | | | | | |
| 70 | Выберите основные области последствий риска: 1. Безрисковая область; 2. Область минимального риска 3. Область повышенного риска 4. Область критического риска 5. Область недопустимого риска 6 Область страхования риска | | | | | | |
| | Тестовые вопросы на нахождение соответствия, выстраивание последовательности | | | | | | |
| 71 | 1. Соотнесите основные черты нового подхода к риск-менеджменту: <table border="1" data-bbox="263 1832 1524 2033"> <tr> <td>А) Интегрированный объединенный риск-менеджмент</td> <td>1 управление рисками координируется высшим руководством, каждый сотрудник предприятия рассматривает риск-менеджмент, как часть своей работы:</td> </tr> <tr> <td>Б) Расширенный риск-менеджмент:</td> <td>2 Процесс управления рисками непрерывен</td> </tr> <tr> <td>В) Непрерывный риск-менеджмент:</td> <td>3 Рассматриваются все риски и возможности их организации.</td> </tr> </table> | А) Интегрированный объединенный риск-менеджмент | 1 управление рисками координируется высшим руководством, каждый сотрудник предприятия рассматривает риск-менеджмент, как часть своей работы: | Б) Расширенный риск-менеджмент: | 2 Процесс управления рисками непрерывен | В) Непрерывный риск-менеджмент: | 3 Рассматриваются все риски и возможности их организации. |
| А) Интегрированный объединенный риск-менеджмент | 1 управление рисками координируется высшим руководством, каждый сотрудник предприятия рассматривает риск-менеджмент, как часть своей работы: | | | | | | |
| Б) Расширенный риск-менеджмент: | 2 Процесс управления рисками непрерывен | | | | | | |
| В) Непрерывный риск-менеджмент: | 3 Рассматриваются все риски и возможности их организации. | | | | | | |
| | а- 1, б – 3, в – 2 | | | | | | |

| | | |
|--|---|---|
| 72 | Соотнесите основные черты старого подхода к риск-менеджменту: | |
| | А) Фрагментированный риск-менеджмент: | 1 Каждый отдел предприятия самостоятельно управляет рисками (в соответствии со своими функциями). Это относится к бухгалтерии, финансовому, экономическому отделам. |
| | Б) Эпизодический риск-менеджмент: | 2 Касается прежде всего страхуемых и финансовых рисков |
| | В) Ограниченный риск-менеджмент: | 3 управление рисками осуществляется тогда, когда менеджеры посчитают это необходимым. |
| A-1, B-3, B – 2 | | |
| Задачи (задания) в 1-2 действия на разные формулы и процессы | | |
| 73 | <p>Задание 1</p> <p>Определить целесообразность инвестирования в акции компании А, имеющей индекс доходности (коэффициент, представляющий собой индекс доходности данного актива по отношению к доходности рынка ценных бумаг в целом) $b = 1,6$, или компании Б, имеющей $b = 0,9$, если доходность безрисковых ценных бумаг $R_f = 6\%$, а доходность в среднем на рынке ценных бумаг в текущем периоде $R_m = 12\%$. Инвестиция осуществляется в том случае, если доходность составляет не менее 15%.</p> <p>Решение</p> <p>Ожидаемая доходность акции соответственно</p> <p>– для компании А: $R_c = 6\% + 1,6 \times (12\% - 6\%) = 15,6\%$; – для компании Б: $R_c = 6\% + 0,9 \times (12\% - 6\%) = 11,4\%$.</p> <p>Таким образом, инвестиция в акции компании А целесообразна.</p> | |
| Кейс-задания (Ситуационные задания) | | |
| 74 | <p>Задание 1</p> <p>Риск увеличения безработицы в регионе может рассматриваться как: – политический, т.к. зависит от социальной политики, проводимой государством и местными властями; – рыночный, т.к. во многом определяется уровнем развития рынка труда и положением предприятия в данном регионе; – социальный, поскольку зависит от уровня образования, демографической ситуации и настроений населения.</p> <p>Вопрос: Каким образом риск увеличения безработицы в регионе может отразиться на деятельности организации?</p> <p>Ответ:</p> <p>Благодаря безработице существует конкуренция между безработными, а значит у предприятий есть выбор. Безработица на деятельность предприятия может нести и положительные аспекты. Есть рабочая сила, которая способна увеличивать предприятия. Но и есть так же отрицательное влияние безработицы на деятельность предприятия, такие как общественные ресурсы недоиспользуют, и часть населения имея очень низкие доходы, эмигрируют.</p> | |
| 75 | <p>Задание 2</p> <p>В результате производственного дефекта автомобиля произошла авария, в которой пострадал владелец и посторонние (третьи) лица. Потерпевшие подали иски с требованием возместить причиненный им вред. Автопроизводитель выплатил им компенсацию.</p> <p>Из-за понесенных расходов и утраты репутации стоимость фирмы уменьшилась. С точки зрения предприятия причина данного события (ошибка при изготовлении автомобиля) является внутренней.</p> <p>Опасное событие (причинение вреда) произошло за пределами предприятия, иски поданы со стороны внешних лиц. Но в результате этих внешних событий предприятие понесло убытки.</p> <p>Вопросы Какие виды рисков можно выделить в описываемой ситуации?</p> <p>Ответ:</p> <p>В данной ситуации можно выделить внутренние причины провоцируют внешнее явление, которое вызывает неблагоприятные последствия для объекта.</p> | |

ПКв-2 Способен давать рекомендации и обеспечивать взаимодействие между заинтересованными сторонами по вопросам управления рисками с целью устойчивого развития организации (ИД2ПКв-2 – Обеспечивает взаимодействие и консультирование заинтересованных сторон по вопросам управления предпринимательскими рисками с целью устойчивого развития организации)

| | |
|-----------|---|
| № задания | Тестовое задание с выбором одного правильного ответа |
| 76 | Хеджирование является примером метода: а) покрытия убытка на основе спонсорства б) покрытие убытка на основе нестрахового пула в) софинансирования риска на основе договора |
| 77 | Принцип управления рисками на уровне фирмы, предусматривающий согласование |

| | |
|----|---|
| | <p>соответствующих специальных мероприятий с возможностями и условиями функционирования фирмы, означает, что:</p> <p>а) система управления риском является частью процедур общего менеджмента фирмы</p> <p>б) при управлении риском следует учитывать внешние и внутренние ограничения</p> <p>в) процесс управления риском носит динамический характер</p> |
| 78 | <p>Этап качественного анализа риска, сопровождаемый исследованием структурных характеристик риска и определяющий, с чем столкнется в дальнейшем менеджер по рискам, задающий границы принятия решений:</p> <p>а) осмысление риска</p> <p>б) идентификация рисков</p> <p>в) комплексный анализ рисков</p> |
| 79 | <p>Отказ от риска является единственной реализацией процедуры:</p> <p>а) аутсорсинга риска</p> <p>б) уклонения от риска</p> <p>в) дублирования риска</p> |
| 80 | <p>Выбор метода и инструментов управления рисками проекта должен:</p> <p>а) быть постоянной функцией</p> <p>б) происходить случайно</p> <p>в) на начальном этапе проекта</p> |
| 81 | <p>Принципы управления риском определяют:</p> <p>а) поведение руководителей</p> <p>б) основные требования к персоналу организации</p> <p>в) требования к системе и организации процесса управления</p> |
| 82 | <p>Инвестиционные проекты, которые предусматривают инвестиции в такие активы, как здания, сооружения, оборудование, относятся к:</p> <p>а) реальным</p> <p>б) финансовым</p> <p>в) производственным</p> |
| 83 | <p>Модифицированная дюрация — коэффициент зависимости изменений цены от изменений доходности, так ли это:</p> <p>а) нет</p> <p>б) лишь отчасти</p> <p>в) да</p> |
| 84 | <p>Этап управления рисками проекта, обеспечивающий обратную связь в системе управления рисками проекта:</p> <p>а) идентификация и анализ рисков</p> <p>б) мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском</p> <p>в) анализ альтернативных методов управления риском</p> |
| 85 | <p>Методы снижения частоты ущерба или предотвращения убытка, уменьшения размера убытков и разделения риска представляют процедуру:</p> <p>а) уклонения от риска</p> <p>б) дублирования риска</p> <p>в) сокращения риска</p> |
| 86 | <p>Покрытие убытка на основе поддержки государственных и муниципальных органов относится к методам:</p> <p>а) передачи риска</p> <p>б) разделения риска</p> <p>в) сокращения риска</p> |
| 87 | <p>Если руководство фирмы предпочитает минимизировать риск банкротства, то оно выбирает ... вариант управления рисками:</p> <p>а) стабильный</p> <p>б) умеренный</p> <p>в) осторожный</p> |
| 88 | <p>Статистический показатель оценки рисков, который характеризует размер отклонения на единицу ожидаемого результата:</p> <p>а) дисперсия</p> <p>б) коэффициент вариации</p> <p>в) среднеквадратическое отклонение</p> |
| 89 | <p>Процедуры «сокращения риска» и «передача риска» являются приоритетными для ... стратегии управления риском:</p> <p>а) осторожной</p> <p>б) взвешенной</p> <p>в) рискованной</p> |
| 90 | <p>К внутренним ограничениям системы управления риском относятся:</p> <p>а) конъюнктурные ограничения</p> |

| | | |
|--|---|--|
| | б) информационные ограничения системы управления риском в) законодательные ограничения | |
| 91 | В основе страхования рисков лежит: а) передача ответственности за риски внешним страховым компаниям б) создание внутренних страховых фондов в) создание внешних страховых резервов | |
| 92 | Ответственность за снижение возможности возникновения неблагоприятных событий возлагается на стороннюю организацию при использовании метода: а) аутсорсинга риска б) уменьшения размера убытков в) отказа от риска | |
| 93 | Средний срок платежей, взвешенный по их приведенной стоимости: а) дюнация б) срок окупаемости в) дюрация | |
| Тестовые вопросы с выбором нескольких вариантов ответа (с указанием количества правильных ответов) | | |
| 94 | Критический риск НЕ характеризуется: а) потерями, равными имущественному состоянию предприятия б) потерями ожидаемой прибыли в) потерями, равными расчетной выручке | |
| 95 | Что из перечисленного является правилами риск-менеджмента? а) нельзя рисковать многим ради малого; б) риск – дело благородное; в) нельзя думать, что существует только одно решение, возможно, есть и другие; г) при существовании нескольких вариантов, следует идти по пути минимально риска; д) положительное решение принимается лишь при отсутствии сомнения. | |
| Тестовые вопросы на нахождение соответствия, выстраивание последовательности | | |
| 96 | 1. Соотнесите: | |
| | А) Субъективно-неопределенная обстановка | 1. обстоятельства и факторы субъективного характера играют основную роль в формировании рисков и шансов, например террористические, криминальные, социальные. |
| | Б) Объективно-неопределенная обстановка | 2. обстоятельства субъективного и объективного непредсказуемого характера в равной мере играют значительную роль в формировании рисков и шансов |
| | В) Случайная обстановка субъективно-объективной непредсказуемости: | 3. обстоятельства и факторы объективного характера играют главенствующую роль в формировании рисков и шансов, а обстоятельства субъективного характера пренебрежимо малы, например экологические, природные, региональные. |
| а - 1, б - 3, в - 2 | | |
| 97 | Факторы инвестиционного риска, возникающие при инновационном проектировании, существенно различаются на этапах создания инновации. В целях укрупненного анализа риска процесс создания инновации разделяют на три основных этапа соотнесите: | |
| | А) Первый этап – | 1. инновационная разработка и проектирование. |
| | Б) Второй этап – | 2 эксплуатация инновации |
| | В) Третий этап – | 3 создание, реализация инновации |
| А-1, Б-3, В - 2 | | |
| Задачи (задания) в 1-2 действия на разные формулы и процессы | | |
| 98 | Задание 1 Предприятие-заемщик заключило договор страхования риска непогашения кредита со страховой компанией. Кредит взят в сумме 120 млн р. под 40% годовых с 1.01.2021 по 31.12.2021 г. Погашение кредита и процентов по нему согласно кредитного договора должно осуществляться раз в полугодие. Заемщик оказался не в состоянии вернуть последний платеж и проценты по нему. Предел ответственности 70%. Страховой тариф 5,2%. Определите страховую сумму, сумму страховых платежей. Решение Определим: 1. страховую стоимость $120 + (120 \times 40\% : 100\%) = 168$ млн.р. 2. страховую сумму $168 \times 70\% : 100\% = 117,6$ млн.р. 3. сумму страховых платежей $117,6 \times 5,2\% : 100\% = 6,12$ млн.р. | |
| Кейс-задания (Ситуационные задания) | | |
| 99 | Задание 1 Определите сумму потерь (ущерба) на 1 га и на всю площадь посева. Если в результате стихийного бедствия часть поля в 12 га пришлось пересевать. Затраты на 1 га составили — 33 тыс. р. Стоимость застрахованного урожая с 1 га определена в 800 тыс. р. Валовой сбор после страхового случая составил 1200 тонн. Цена 1 тонны — 26 тыс. р. Общая площадь посева — 50 га. | |

| | |
|-----|--|
| | <p>Решение Определим:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. стоимость застрахованного урожая со всей площади $800 \times 50 = 40000$ тыс.р. 2. валовой сбор урожая после страхового случая $1200 \times 26 = 31200$ тыс.р. 3. расходы по пересеву $12 \times 33 = 396$ тыс.р. 4. сумму возмещения со всей площади посева $40000 - 31200 + 396 = 9196$ тыс.р. 5. сумму потерь на 1 га. $9196 : 50 = 183,9$ тыс.р. |
| 100 | <p>Задание 2</p> <p>Рассмотрите вложение в 1000 у.е., которое станет 1500 у.е. через три года при условии годовой ставки дисконта в 8%. Определите, выгодно ли данное вложение путем расчета чистой дисконтированной стоимости.</p> <p>Решение Чистая дисконтированная стоимость определяется Р чист.: $R_{\text{чист.}} = Pt : (1+i)^n - P$ $R_{\text{чист.}} = 1500 : (1+0,08)^3 - 1000 = 20,87$ у.е. Вложение выгодно.</p> |

3.2 Вопросы для экзамена

3.2.1 Шифр и наименование компетенции ____ ПКв-1 Способен

планировать, координировать и обеспечивать интегрированную комплексную деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации (ИД1ПКв-1 - Использует принципы, определяет цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации в соответствии со стратегическими целями организации)

Вопросы для экзамена

| Номер вопроса | Текст вопроса |
|---------------|--|
| 101 | <p>Понятие риск-менеджмента. Риск-менеджмент – это специфическая система (подсистема) управления, направленная на разработку и реализацию экономически обоснованных для данного предприятия (организации) рекомендаций и мероприятий по уменьшению негативного воздействия рисков. В основе риск-менеджмента лежат целенаправленный поиск и организация работы по снижению степени риска, искусство получения и увеличения дохода (выигрыша, прибыли, выгоды) в неопределенной предпринимательской среде.</p> |
| 102 | <p>Задачи системы управления рисками. Задачами процесса управления рисками являются своевременная идентификация всех существенных рисков, оценка вероятности, материальности и последствий их наступления, создание систем и принятие мер по минимизации негативных и увеличению положительных последствий их наступления.</p> |
| 103 | <p>Перечислите методы управления рисками. Методы компенсации рисков, включающие прогнозирование внешней среды предприятия, маркетинг предприятия и продуктов предприятия, мониторинг социально-экономической и правовой среды и создание системы резервов предприятия; Методы распределения рисков, включающие распределение рисков по времени, распределение рисков между участниками и проч. Методы локализации рисков, применяемые для высокорисковой деятельности предприятия в многопроектной системе, подразумевающие создание отдельных специальных подразделений для реализации особо рискованных проектов предприятия; Методы ухода от рисков, включающие отказ от рискованных проектов предприятия и ненадежных партнеров, страхование рисков, поиск гарантов.</p> |
| 104 | <p>Перечислите методы уклонения от риска. 1. Диверсификация, или распределение рисков (распределение усилий предприятия между видами деятельности, результаты которых непосредственно не связаны между собой), позволяющие распределить риски между участниками деятельности. 2. Резервирование. 3. Страхование рисков. 4. Адаптация.</p> |
| 105 | <p>Противоречивые понятия (спекулятивный риск). Спекулятивный риск – это риск того, что какое-либо действие приведет к неизвестному уровню прибыли или убытка. В частности, теоретический риск – это вероятность того, что инвестиции не оценят по достоинству. Спекулятивный риск обычно становится сознательным выбором и уменьшается только в результате неконтролируемых обстоятельств. Спекулятивный риск охватывает практически всю инвестиционную деятельность, поскольку инвестор</p> |

никогда не знает, будет ли инвестиция полностью успешной или неудачной.

3.2.2 Шифр и наименование компетенции _____ ПКв-1 Способен планировать, координировать и обеспечивать интегрированную комплексную деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации (ИД2ПКв-1 - Планирует, контролирует и осуществляет профессиональную деятельность в сфере управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации)

Вопросы для экзамена

| Номер вопроса (задачи, задания) | Текст вопроса |
|---------------------------------|--|
| 106 | <p>Понятие внутреннего контроля.</p> <p>Внутренний контроль – процесс, осуществляемый на всех уровнях деятельности организации, направленный на обеспечение разумной уверенности в том, что будут достигнуты цели организации в части: эффективности и экономичности операций; достоверности финансовой отчетности; соответствия деятельности действующему законодательству.</p> <p>Внутренний контроль является не одним событием или обстоятельством, а динамическим и итеративным процессом – действиями, которые охватывают всю деятельность организации, и которые неразрывно связаны с тем, каким образом менеджмент управляет организацией.</p> |
| 107 | <p>Идентификация риска.</p> <p>Идентификация рисков — поиск ответов на вопросы: где, когда, почему и как рискованные ситуации могут препятствовать или благоприятствовать достижению запланированных результатов (целей).</p> <p>Идентификация рисков — сравнение объекта с некоторым эталоном; установление тождественности объектов на основании тех или иных признаков; этап обработки информации, связанный с выявлением смыслового содержания и установлением его тождества с реальным объектом; распознавание объекта по одному или нескольким атрибутам.</p> <p>Идентификация рисков — определение источника риска, события и потенциальных последствий реализации рискованного события.</p> <p>Идентификация рисков — систематическая проверка исследуемой системы с целью идентификации типа присутствующих неустраняемых опасностей и способов их проявления.</p> <p>Источник риска — причина, предпосылка рискованной ситуации, которые способны причинить потенциальный вред, ущерб или содействовать проявлениям со стороны потенциально опасных объектов (например, конкурентов) регулятивных требований.</p> |
| 108 | <p>Понятий угроза и опасность в риск-менеджменте.</p> <p>Угроза: 1) обещание причинить зло, неприятность; 2) возможность, опасность возникновения чего-либо неприятного, тяжелого.</p> <p>Опасность – это: 1) отвлеченное существительное по значению прилагательного: опасный; 2) возможность чего-либо опасного, какого-либо несчастья, вреда.</p> <p>По сути определений понятий и угрозы, и опасности также обладают свойствами неопределенности, негативных последствий и принадлежностью, в силу субъективности представления возможности негативных последствий.</p> |
| 109 | <p>Функции риск-менеджмента.</p> <p>Риск-менеджмент выполняет определенные функции. Различают два типа функций риск-менеджмента: – функции объекта управления; – функции субъекта управления.</p> <p>К функциям объекта управления в риск-менеджменте относится организация: – разрешения риска; – рискованных вложений капитала; – работы по снижению величины риска; – процесса страхования рисков; – экономических отношений и связей между субъектами хозяйственного процесса.</p> <p>К функциям субъекта управления в риск-менеджменте относятся: – прогнозирование; – организация; – регулирование; – координация; – стимулирование; – контроль.</p> |
| 110 | <p>Организация риск-менеджмента.</p> <p>Риск-менеджмент по экономическому содержанию представляет собой систему управления риском и финансовыми отношениями, возникающими в процессе этого управления. Включает в себя процесс выработки цели риска и рискованных вложений капитала, определение вероятности наступления события, выявление степени и величины риска, анализ окружающей обстановки, выбор стратегии управления риском, выбор необходимых для данной стратегии приемов управления риском и способов его снижения (т.е. приемов риск-менеджмента), осуществление целенаправленного воздействия на риск.</p> <p>Организация в широком плане представляет собой совокупность процессов или действий, ведущих к образованию и совершенствованию взаимосвязей между частями целого. Она представляет собой систему мер, направленных на рациональное сочетание всех его элементов в единой технологии процесса управления риском.</p> <p>Первым этапом организации риск-менеджмента является определение цели риска и цели рискованных вложений капитала. Цель риска – это результат, который необходимо получить. Им может быть выигрыш, прибыль, доход и т. п.</p> |

3.2.3 Шифр и наименование компетенции ПКв-2 Способен давать рекомендации и обеспечивать взаимодействие между заинтересованными сторонами по вопросам управления рисками с целью устойчивого развития организации (ИД1ПКв-2 – Изучает, анализирует и оценивает предпринимательскую среду организации с целью разработки предложений по снижению рисков)

Вопросы для экзамена

| Номер вопроса (задачи, задания) | Текст вопроса |
|---------------------------------|---|
| 111 | <p>Понятие контроллинг.</p> <p>Контроллинг – инструмент сбора информации, учета, анализа и внесения изменений – входит в процесс управления рисками и включает в себя: – мониторинг управления рисками; – анализ управления рисками; – аудит и координацию управления рисками; – оценку эффективности управления рисками; – корректировку процессов управления рисками.</p> <p>Средства контроля разработаны и установлены таким образом, чтобы обеспечивать "разумную" гарантию, что реагирование на идентифицированный риск происходит эффективно и своевременно, а сам процесс идентификации позволяет выявить максимально возможное число рисков. Процедуры контроля рисков подлежат максимально возможной автоматизации.</p> |
| 112 | <p>Основные этапы процесса управления рисками.</p> <p>Процесс управления риском является сложной и многоуровневой процедурой. Тем не менее его можно условно разделить на ряд этапов в соответствии с особенностями последовательности действий по управлению риском.</p> <p>Этап 1. Идентификация и анализ риска;</p> <p>Этап 2. Анализ альтернативных методов управления риском;</p> <p>Этап 3. Выбор методов управления риском;</p> <p>Этап 4. Исполнение выбранного метода управления риском;</p> <p>Этап 5. Мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском.</p> |
| 113 | <p>Реагирование на риск</p> <p>Общепринятыми способами реагирования на риски являются: избежание риска, снижение риска, передача риска, принятие риска.</p> <p>Способ реагирования на конкретный риск выбирается с учётом его положения в карте рисков компании – показателей вероятности наступления и степени влияния на цели компании.</p> <p>При определении способа реагирования на риск, оценивается соотношение затрат и выгод от потенциальной реакции на риск.</p> |
| 114 | <p>Что включает анализ управления рисками.</p> <p>Анализ управления рисками осуществляется в рамках текущей деятельности системы управления рисками или проведением периодических оценок; проводится контроль мероприятий, предусмотренных соответствующими приказами и распоряжениями руководства, входящих в План управления рисками.</p> <p>Анализ управления рисками включает в себя: – контроль сроков выполнения мероприятий; – подготовку отчетов для руководства о ходе выполнения мероприятий; – разработку предложений по выполнению Плана управления рисками и корректировке Плана управления рисками; – контроль полноты выполнения Плана управления рисками.</p> |
| 115 | <p>Этап планирования мероприятий по управлению рисками включает...</p> <p>Этап планирования мероприятий по управлению рисками Этап подготовки включает в себя: – анализ рисков; – уточнение и корректировку документации; – оценку влияния рисков на стратегические цели будущего периода (будущего года); – составление и анализ корпоративного профиля рисков; – разработку и утверждение Плана управления рисками на будущий год, а также корректировку и актуализацию документации системы управления рисками; – выработку критериев управления рисками (установку приемлемых уровней, нормативов и т.п.); – разработку и утверждение политики управления рисками.</p> |

3.2.4 Шифр и наименование компетенции ПКв-2 Способен давать по вопросам управления рисками с целью устойчивого развития организации (ИД2ПКв-2 – Обеспечивает взаимодействие и консультирование заинтересованных сторон по вопросам управления предпринимательскими рисками с целью устойчивого развития организации)

Вопросы для экзамена

| Номер вопроса (задачи, | Текст вопроса |
|------------------------|---------------|
| | |

| | |
|----------|---|
| задания) | |
| 116 | Инвестиционная деятельность в риск-менеджменте. Инвестиционная деятельность – процесс передачи под обязательства инвестируемому лицу имеющихся в распоряжении инвестиций, принадлежащих инвестору, на основании, дающем право на осуществление данного вида деятельности и осуществление других связанных с инвестированием практических действий. Инвестиционная деятельность способствует развитию производства, техники, строительства, созданию новых предприятий, направлений науки, развития социальной и культурной сферы жизни общества. |
| 117 | Перечислите этапы инвестиционной деятельности. Подготовительный этап. Инвестор принимает решение о вложении средств в качестве инвестиций. На этом этапе ведется разработка и анализ инвестиционного проекта, в который входят обоснование экономической целесообразности, объема и сроков инвестиций. Инвестиционный этап. В этот период осуществляется совокупность практических действий по реализации инвестиционного проекта; создается календарный план-график по реализации инвестиционной деятельности. Эксплуатационный этап. Организуется: производство товаров; выполнение работ; оказание услуг; реализуется система сбыта нового товара и т.п. Инвестиции и затраты на осуществление инвестиционного проекта начинают компенсироваться и самоокупаться. На этом этапе наступает срок окупаемости инвестиционного проекта – срок со дня начала финансирования проекта до дня, когда разность между накопленной суммой чистой прибыли с амортизационными отчислениями и объемом инвестиционных затрат приобретает положительное значение. Этап завершается реализацией инвестиционного проекта. |
| 118 | Перечислите типичные ошибки в риск-менеджменте. К типичным ошибкам и источникам дополнительной неопределенности в риск-менеджменте относят: – многозначность (нечеткость) определений; – противоречивые понятия; – отсутствие комплекса стандартов РФ; – ошибки перевода стандартов риск-менеджмента; – нечеткие цели и задачи; – инвестиционные риски; – отсутствие мотивации персонала; – отсутствие стабильных знаний; – отсутствие навыков персонала; – противодействие незаинтересованных лиц; – риски проекта создания системы управления риском; – ошибки эксплуатации системы управления риском; – неоднозначность оценки эффективности системы управления риском; – нечеткая методология системы управления риском; – ошибки в принятии решений; – ошибки автоматизации; – сбои в обратной связи системы управления риском; – ошибки в классификации рисков. |
| 119 | Перечислите методы снижения риска. Снижение риска – процесс, направленный на уменьшение негативных последствий риска и их соответствующих вероятностей. Если снижение вероятности проводится только до события, то снижение последствий может быть как до, так и после события. Методы снижения риска: – снижение частоты ущерба или предотвращение убытков; – уменьшение размера убытков; – разделение риска (диверсификация и дублирование и др.); – покрытие убытка на основе самострахования. |
| 120 | Методы передачи риска. Передача риска – перенесение всего или части риска на другое лицо (сторону). Примером является заключение договора страхования, в соответствии с которым определен риск передается от страхователя страховщику. Методы передачи риска: – страхование; – передача ответственности по договору; – создание совместного предприятия; – покрытие убытка на основе поддержки государственных и муниципальных органов; – покрытие убытка на основе нестрахового пула; – покрытие убытка на основе спонсорства. Передача риска может привести новые риски, могущие обладать слабой управляемостью |

4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Процедуры оценивания в ходе изучения дисциплины знаний, умений и навыков, характеризующих этапы формирования компетенций, регламентируются положениями:

- П ВГУИТ 2.4.03 Положение о курсовых экзаменах и зачетах;

- П ВГУИТ 4.1.02 Положение о рейтинговой оценке текущей успеваемости, а также методическими указаниями:

Корпоративные системы риск-менеджмента [Электронный ресурс]: задания для самостоятельной работы студентов для студентов, обучающихся по направлению 38.04.02 – «Менеджмент», очной формы обучения / Е. И. Кривенко [и др.] ; ВГУИТ, Кафедра

управления, организации производства и отраслевой экономики. - Воронеж : ВГУИТ, 2021. - 24 с.

В методических указаниях указывается порядок проведения оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, и выставления оценки по дисциплине.

Для оценки знаний, умений, навыков обучающихся по дисциплине применяется рейтинговая система. Итоговая оценка по дисциплине определяется на основании определения среднеарифметического значения баллов по каждому заданию.

5. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания для каждого результата обучения по дисциплине/практике

| Результаты обучения по этапам формирования компетенций | Предмет оценки (продукт или процесс) | Показатель оценивания | Критерии оценивания сформированности компетенций | Шкала оценивания | |
|---|---|------------------------------------|--|--------------------------------|------------------------------|
| | | | | Академическая оценка или баллы | Уровень освоения компетенции |
| Шифр и наименование компетенции _____ | | | | | |
| ПКв-1 Способен планировать, координировать и обеспечивать интегрированную комплексную деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации (ИД1ПКв-1 - Использует принципы, определяет цели и механизмы функционирования, планирования, координирования и обеспечения интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками организации в соответствии со стратегическими целями организации) | | | | | |
| Знать | Знание принципов построения систем управления рисками | Результаты тестирования | - даны правильные ответы менее чем на 59,99 % всех тестовых вопросов | Неудовлетворительн о | Не освоена (недостаточный) |
| | | | - даны правильные ответы на 60-74,99% всех тестовых вопросов | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | - даны правильные ответы на 75-84,99% всех тестовых вопросов | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | - даны правильные ответы на 85-100% всех тестовых вопросов | Отлично | Освоена (повышенный) |
| | | Собеседование Ответы на вопросы | обучающийся обладает частичными и разрозненными знаниями, только некоторые из которых может связывать между собой | Неудовлетворительн о | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся обладает минимальным набором знаний, необходимым для системного взгляда на изучаемый объект | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся обладает набором знаний, достаточным для системного взгляда на изучаемый объект | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся обладает системным взглядом на изучаемый объект | Отлично | Освоена (повышенный) |
| Уметь | Умение организовывать процесс управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов | Решение практических задач | обучающийся не владеет навыками выполнения заданий; не демонстрирует умений, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительн о | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся испытывает затруднения при выполнении заданий по алгоритму; демонстрирует минимальный набор умений предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся выполняет задания с использованием алгоритма решения, при выполнении допускает незначительные ошибки и неточности, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные | Хорошо; | Освоена (повышенный) |

| | | | | | |
|----------------|---|---------------------------------|---|-------------------------|----------------------------|
| | | | планируемыми результатами обучения | | |
| | | | обучающийся выполняет задания, формируя алгоритм решения, при выполнении не допускает ошибок и неточностей, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |
| Владеть | Навыки использования принципов построения системы управления рисками в обеспечении деятельности организации | Результаты решения кейс-заданий | обучающийся не владеет навыками выполнения заданий; не демонстрирует умений, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительн о | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся испытывает затруднения при выполнении заданий по алгоритму; демонстрирует минимальный набор умений предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся выполняет задания с использованием алгоритма решения, при выполнении допускает незначительные ошибки и неточности, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся выполняет задания, формируя алгоритм решения, при выполнении не допускает ошибок и неточностей, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |
| | | Выполнение рпр | обучающийся не может (не умеет) записать алгоритм выполнения работы, не может выбрать методику для проведения расчетов, не представляет результаты работы в виде аналитического отчета; не демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительн о | Не освоена (недостаточный) |
| | | | запись алгоритма решения РПР у обучающегося вызывает затруднения (алгоритм решения записан с ошибками), представляет результаты работы в виде аналитического отчета, в котором допускает неверное оформление; демонстрирует минимальный набор навыков, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся решает РПР, используя | Хорошо; | Освоена |

| | | | | | |
|--|--|---|--|----------------------|----------------------------|
| | | | верный алгоритм решения, при решении допускает незначительные ошибки, представляет результаты работы в виде правильно оформленного аналитического отчета; демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | | (повышенный) |
| | | | обучающийся решает РПР, используя верный алгоритм решения, при решении не допускает ошибок, представляет результаты работы в виде правильно оформленного аналитического отчета; демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |
| Шифр и наименование компетенции _____ | | | | | |
| ПКв-1 Способен планировать, координировать и обеспечивать интегрированную комплексную деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации (ИД2ПКв-1 - Планирует, контролирует и осуществляет профессиональную деятельность в сфере управления отдельными видами рисков, обеспечивающую получение оптимального результата деятельности организации) | | | | | |
| Знать | Знание полномочий и обязательств менеджмента по реализации плана управления рисками. | Результаты тестирования | - даны правильные ответы менее чем на 59,99 % всех тестовых вопросов | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |
| | | | - даны правильные ответы на 60-74,99% всех тестовых вопросов | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | - даны правильные ответы на 75-84,99% всех тестовых вопросов | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | - даны правильные ответы на 85-100% всех тестовых вопросов | Отлично | Освоена (повышенный) |
| | | Собеседование Ответы на вопросы | обучающийся обладает частичными и разрозненными знаниями, только некоторые из которых может связывать между собой | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся обладает минимальным набором знаний, необходимым для системного взгляда на изучаемый объект | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся обладает набором знаний, достаточным для системного взгляда на изучаемый объект | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | обучающийся обладает системным взглядом на изучаемый объект | Отлично | Освоена (повышенный) | |
| Уметь | Умение разрабатывать регламентирующие документы по управлению | Решение практических задач | обучающийся не владеет навыками выполнения заданий; не демонстрирует умений, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |

| | | | | | |
|----------------|--|---------------------------------|---|---------------------|----------------------------|
| | рисками | | обучающийся испытывает затруднения при выполнении заданий по алгоритму; демонстрирует минимальный набор умений предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся выполняет задания с использованием алгоритма решения, при выполнении допускает незначительные ошибки и неточности, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся выполняет задания, формируя алгоритм решения, при выполнении не допускает ошибок и неточностей, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |
| Владеть | Навыки коммуникации и консультации с заинтересованными сторонами на всех стадиях процесса управления рисками | Результаты решения кейс-заданий | обучающийся не владеет навыками выполнения заданий; не демонстрирует умений, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся испытывает затруднения при выполнении заданий по алгоритму; демонстрирует минимальный набор умений предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся выполняет задания с использованием алгоритма решения, при выполнении допускает незначительные ошибки и неточности, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся выполняет задания, формируя алгоритм решения, при выполнении не допускает ошибок и неточностей, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |
| | | Выполнение рпр | обучающийся не может (не умеет) записать алгоритм выполнения работы, не может выбрать методику для проведения расчетов, не представляет результаты работы в виде аналитического отчета; не демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |

| | | | | | |
|--|--|--|---|--------------------|----------------------|
| | | | запись алгоритма решения РПР у обучающегося вызывает затруднения (алгоритм решения записан с ошибками), представляет результаты работы в виде аналитического отчета, в котором допускает неверное оформление; демонстрирует минимальный набор навыков, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся решает РПР, используя верный алгоритм решения, при решении допускает незначительные ошибки, представляет результаты работы в виде правильно оформленного аналитического отчета; демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся решает РПР, используя верный алгоритм решения, при решении не допускает ошибок, представляет результаты работы в виде правильно оформленного аналитического отчета; демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |

Шифр и наименование компетенции _____

ПКв-2 Способен давать рекомендации и обеспечивать взаимодействие между заинтересованными сторонами по вопросам управления рисками с целью устойчивого развития организации (ИД1ПКв-2 – Изучает, анализирует и оценивает предпринимательскую среду организации с целью разработки предложений по снижению рисков)

| | | | | | |
|--------------|---|------------------------------------|---|---------------------|----------------------------|
| Знать | Знание основ методологии управления рисками | Результаты тестирования | - даны правильные ответы менее чем на 59,99 % всех тестовых вопросов | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |
| | | | - даны правильные ответы на 60-74,99% всех тестовых вопросов | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | - даны правильные ответы на 75-84,99% всех тестовых вопросов | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | - даны правильные ответы на 85-100% всех тестовых вопросов | Отлично | Освоена (повышенный) |
| | Собеседование Ответы на вопросы | Собеседование Ответы на вопросы | обучающийся обладает частичными и разрозненными знаниями, только некоторые из которых может связывать между собой | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся обладает минимальным набором знаний, необходимым для системного взгляда на изучаемый объект | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся обладает набором знаний, достаточным для системного взгляда на изучаемый объект | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся обладает системным взглядом | Отлично | Освоена |

| | | | | | |
|----------------|---|---------------------------------|---|---------------------|----------------------------|
| Уметь | Умение анализировать корпоративные нормативные акты, информацию о порядке и особенностях выполнения действий по управлению рисками и эффективность выполнения этих действий | Решение практических задач | на изучаемый объект | | (повышенный) |
| | | | обучающийся не владеет навыками выполнения заданий; не демонстрирует умений, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся испытывает затруднения при выполнении заданий по алгоритму; демонстрирует минимальный набор умений предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся выполняет задания с использованием алгоритма решения, при выполнении допускает незначительные ошибки и неточности, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся выполняет задания, формируя алгоритм решения, при выполнении не допускает ошибок и неточностей, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |
| Владеть | Навыки согласования методологий по управлению рисками в организации | Результаты решения кейс-заданий | обучающийся не владеет навыками выполнения заданий; не демонстрирует умений, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся испытывает затруднения при выполнении заданий по алгоритму; демонстрирует минимальный набор умений предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся выполняет задания с использованием алгоритма решения, при выполнении допускает незначительные ошибки и неточности, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся выполняет задания, формируя алгоритм решения, при выполнении не допускает ошибок и неточностей, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |
| | | Выполнение рпр | обучающийся не может (не умеет) записать алгоритм выполнения работы, не может | Неудовлетворительно | Не освоена (недостаточный) |

| | | | | | |
|--|--|--|---|--------------------|----------------------|
| | | | выбрать методику для проведения расчетов, не представляет результаты работы в виде аналитического отчета; не демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | о | |
| | | | запись алгоритма решения РПР у обучающегося вызывает затруднения (алгоритм решения записан с ошибками), представляет результаты работы в виде аналитического отчета, в котором допускает неверное оформление; демонстрирует минимальный набор навыков, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся решает РПР, используя верный алгоритм решения, при решении допускает незначительные ошибки, представляет результаты работы в виде правильно оформленного аналитического отчета; демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся решает РПР, используя верный алгоритм решения, при решении не допускает ошибок, представляет результаты работы в виде правильно оформленного аналитического отчета; демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |

Шифр и наименование компетенции _____

ПКв-2 Способен давать по вопросам управления рисками с целью устойчивого развития организации (ИД2ПКв-2 – Обеспечивает взаимодействие и консультирование заинтересованных сторон по вопросам управления предпринимательскими рисками с целью устойчивого развития организации)

| | | | | | |
|--------------|-----------------------------------|--|---|--------------------------|----------------------------|
| Знать | Знание основ управления проектами | Результаты тестирования | - даны правильные ответы менее чем на 59,99 % всех тестовых вопросов | Неудовлетворительно о | Не освоена (недостаточный) |
| | | | - даны правильные ответы на 60-74,99% всех тестовых вопросов | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | - даны правильные ответы на 75-84,99% всех тестовых вопросов | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | - даны правильные ответы на 85-100% всех тестовых вопросов | Отлично | Освоена (повышенный) |
| | | Собеседование Ответы на вопросы | обучающийся обладает частичными и разрозненными знаниями, только некоторые из которых может связывать между собой | Неудовлетворительно о | Не освоена (недостаточный) |
| | | обучающийся обладает минимальным набором знаний, необходимым для | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) | |

| | | | | | |
|----------------|--|---------------------------------|---|-------------------------|----------------------------|
| | | | системного взгляда на изучаемый объект | | |
| | | | обучающийся обладает набором знаний, достаточным для системного взгляда на изучаемый объект | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся обладает системным взглядом на изучаемый объект | Отлично | Освоена (повышенный) |
| Уметь | Умение применять стандарты в области риск-менеджмента и лучшие практики в области создания и поддержания культуры управления рисками в организации | Решение практических задач | обучающийся не владеет навыками выполнения заданий; не демонстрирует умений, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительн о | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся испытывает затруднения при выполнении заданий по алгоритму; демонстрирует минимальный набор умений предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся выполняет задания с использованием алгоритма решения, при выполнении допускает незначительные ошибки и неточности, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся выполняет задания, формируя алгоритм решения, при выполнении не допускает ошибок и неточностей, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |
| Владеть | Навыки реализации специальных проектов по управлению рисками по запросу руководства | Результаты решения кейс-заданий | обучающийся не владеет навыками выполнения заданий; не демонстрирует умений, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительн о | Не освоена (недостаточный) |
| | | | обучающийся испытывает затруднения при выполнении заданий по алгоритму; демонстрирует минимальный набор умений предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся выполняет задания с использованием алгоритма решения, при выполнении допускает незначительные ошибки и неточности, формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся выполняет задания, формируя алгоритм решения, при выполнении не допускает ошибок и неточностей, | Отлично | Освоена (повышенный) |

| | | | | | |
|--|--|----------------|---|-------------------------|-------------------------------|
| | | | формулирует выводы; демонстрирует умения, предусмотренные планируемыми результатами обучения | | |
| | | Выполнение рпр | обучающийся не может (не умеет) записать алгоритм выполнения работы, не может выбрать методику для проведения расчетов, не представляет результаты работы в виде аналитического отчета; не демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Неудовлетворительн о | Не освоена (недостаточный) |
| | | | запись алгоритма решения РПР у обучающегося вызывает затруднения (алгоритм решения записан с ошибками), представляет результаты работы в виде аналитического отчета, в котором допускает неверное оформление; демонстрирует минимальный набор навыков, предусмотренных планируемыми результатами обучения | Удовлетворительно; | Освоена (базовый) |
| | | | обучающийся решает РПР, используя верный алгоритм решения, при решении допускает незначительные ошибки, представляет результаты работы в виде правильно оформленного аналитического отчета; демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Хорошо; | Освоена (повышенный) |
| | | | обучающийся решает РПР, используя верный алгоритм решения, при решении не допускает ошибок, представляет результаты работы в виде правильно оформленного аналитического отчета; демонстрирует навыки, предусмотренные планируемыми результатами обучения | Отлично | Освоена (повышенный) |