


Утверждено приказом ДонГУУ от 23.08.2016г. № 657

ДОНЕЦКАЯ НАРОДНАЯ РЕСПУБЛИКА
МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ
ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ПРОФЕССИОНАЛЬНОГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ДОНЕЦКАЯ АКАДЕМИЯ УПРАВЛЕНИЯ И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ
ПРИ ГЛАВЕ ДОНЕЦКОЙ НАРОДНОЙ РЕСПУБЛИКИ»

ФАКУЛЬТЕТ ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ И УПРАВЛЕНИЯ
КАФЕДРА ИННОВАЦИОННОГО МЕНЕДЖМЕНТА И УПРАВЛЕНИЯ ПРОЕКТАМИ

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной работе

 Л.Н.Костина

20. 06. 2017 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

«Управление рисками»

Направление подготовки 38.04.04 «Государственное и муниципальное
управление»

Магистерские программы «Управление проектами»
«Инновационный и проектный менеджмент»
«Управление интеллектуальной собственностью»

Донецк
2017

Рабочая программа учебной дисциплины «Управление рисками» для студентов 2 курса образовательного уровня «магистр», направления подготовки 38.04.04 «Государственное и муниципальное управление», (магистерские программа «Управление проектами», «Инновационный и проектный менеджмент», «Управление интеллектуальной собственностью») дневной и заочной формы обучения.

Автор,

разработчик: профессор кафедры ИМУП, д.э.н., доцент А.И.Ярембаш

Программа рассмотрена на заседании ПМК кафедры

Инновационный, проектный менеджмент и управление интеллектуальной собственностью

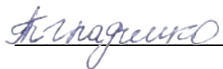
Протокол заседания ПМК от

08.06.2017

№

11

Председатель ПМК



Т.Н. Гладченко

Программа рассмотрена на заседании кафедры

Инновационного менеджмента и управления проектами

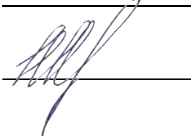
Протокол заседания кафедры от

09.06.2017

№

13

Заведующий кафедрой



Е.Л. Морозов

1. Цель освоения дисциплины и планируемые результаты обучения по дисциплине (соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы)

Цели и задачи дисциплины

Целью учебной дисциплины «Управление рисками» является обеспечение фундаментальной и практической профессиональной подготовки обучающихся в области теории и практики управления рисками, а также освоения методами оценки результативности системы управления рисками. Дисциплина призвана обеспечить формирование системы знаний о современной концепции управления рисками в организациях, сформированных на корпоративных правах и бюджетной основе.

2. Место дисциплины в структуре ООП

2.1 Требования к предварительной подготовке обучающихся:

«Управление рисками» представляет собой самостоятельную дисциплину, выступающую составной частью образовательной программы по направлению подготовки 38.04.04 «Государственное и муниципальное управление», дисциплина входит в вариативную часть. Дисциплина «Управление рисками» требует предварительной подготовки по дисциплинам: Механизмы государственного управления; Управление проектами, Операционный менеджмент, Организация инновационного предпринимательства, Инновационный менеджмент и др.

2.2 Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее:

Основные положения дисциплины должны быть использованы в дальнейшем при прохождении преддипломной практики, а также для подготовки магистерской диссертации.

2.3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)

В результате освоения дисциплины студент должен:

Знать: концептуально-теоретические основы управления рисками, обеспечения конкурентоспособности корпораций.

Уметь: использовать методы и инструменты управления рисками для принятия управленческих решений по реализации конкретных проектов и решений по финансированию на рост ценности корпорации и бюджетных организаций, применять приемы риск-менеджмента в целях внедрения технологических продуктов и инноваций.

Владеть: навыками анализа и разработки системы риск-менеджмента, проводить оценку вариативных инвестиционных управленческих проектов; владеть навыками разработки систем управления рисками организации владеть методами оценки результативности системы управления рисками.

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

	Зачетные единицы (кредиты ECTS)	Всего часов		Форма обучения	
		О	З	Очная	Заочная
				Семестр № 3	Семестр № 3
Общая трудоемкость	4	144	144	Количество часов на вид работы:	
Виды учебной работы, из них:					
Аудиторные занятия (всего)				36	12
В том числе:					
Лекции				10	4
Семинарские занятия /Практические занятия				26	8
Самостоятельная работа (всего)				108	132
Промежуточная аттестация					
В том числе:					
зачет /экзамен				экзамен	экзамен

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

4.1. Разделы (темы) дисциплины с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

Таблица пункта 4.1.

Наименование раздела, темы дисциплины	Виды учебной работы (бюджет времени) (вносятся данные по реализуемым формам)									
	Дневная форма обучения					Заочная форма обучения				
	Лекции	Практические занятия	Семинарские занятия	Самостоятельная работа	Всего	Лекции	Практические занятия	Семинарские занятия	Самостоятельная работа	Всего
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
Раздел 1. Виды рисков и организация управления ими										
Тема 1.1. Виды рисков и их классификация	2		4	20	26	-		-	26	26
Тема 1.2. Методы выявления и оценки риска. Финансирование риска	2		6	22	30	-		2	24	26
Итого по разделу:	4		10	42	56			2	50	52
Раздел 2. Эффективность управления рисками. принятие решений в условиях риска										
Тема 2.1. Оценка эффективности методов управления риском	2		4	22	28	2		2	26	30
Тема 2.2. Управление инвестиционными рисками	2		6	22	30	2		2	26	30
Тема 2.3. Принятие управленческих решений в условиях риска	2		6	22	30	-		2	30	32
Итого по разделу	6		16	66	88	2		6	82	92
Итого за семестр	10		26	108	144	4		8	132	144

4.2 Содержание разделов дисциплины

Таблица пункта 4.2.

Наименование раздела, темы дисциплины	Содержание разделов дисциплины	Содержание семинарских/практических занятий		
			Кол-во часов	
			О	З
1	2	3	4	5
Раздел 1. Виды рисков и организация управления ими			10	2
Тема 1.1. Виды рисков и их классификация	Современная концепция риск-менеджмента. Роль риск-менеджмента в общей системе менеджмента корпорации. Организационно-экономические и правовые аспекты возникновения рисков в организациях, и их последствия. Основные задачи риск-менеджмента в экономике. Задачи управления риском, сущность и содержание. Организация и совершенствование процесса управления рисками. Формирование расходов на управление рисками. Влияние рисков на доходность корпоративных организаций. Современные научные и практические подходы к многомерному управлению рисками. Четырёхмерная модель рискового профиля фирмы. Учёт динамики управления рисками и готовность к новым рискам	Семинарское занятие	4	-
		1. Определения риска. 2. Факторы риска в предпринимательстве. 3. Особенности производственной деятельности организации? 4. Основные виды финансово-кредитной и коммерческой деятельности фирмы. 5. Характеристика посреднической деятельности. 6. Сущность моделей формирования результата в условиях определенности и риска. 7. Риск-анализ экономической деятельности организации.	4	-
Тема 1.2. Методы выявления и оценки риска. Финансирование риска	Стратегический анализ деятельности корпорации в целях выработки направлений менеджмента рисков. Анализ рисков внешней среды корпоративных образований. Диагностика корпорации с помощью калькулятора внутренней рискованности. Система классификации рисков: новые, и специфические риски. Особенности жизненного цикл и измерение рискового спектра корпорации в условиях неопределенности. Структура рискового множества и диагностика рисков корпораций: идентификация рисков, рисковый спектр, рисковый профиль. Современные методы диагностики рисков корпоративных организаций. Картографирование рисков организации. Концепция интегрированной системы управления рисками в корпорациях на основе разработки программы управления рисками и плана ситуационного управления.	Семинарское занятие	6	2
		1. Формы предпринимательской деятельности и характер проявлений в них риска. 2. Особенности рисков произв-й деятельности. 3. Основные формы и риски финансово-кредитной деятельности организации. 4. Риски фондового рынка. 5. Сущность опционов «колл» и «пут»? 6. Роль коммерческих и посреднических рисков в предпринимательстве.	6	2
Раздел 2. Эффективность управления рисками. принятие решений в условиях риска			16	6
	Группы риска и их краткая характеристика	Семинарское занятие	4	2

Наименование раздела, темы дисциплины	Содержание разделов дисциплины	Содержание семинарских/практических занятий		
			Кол-во часов	
			О	З
1	2	3	4	5
Тема 2.1. Оценка эффективности методов управления риском	Склонность к различного рода зависимостям. Оценка при приеме на работу принадлежности кандидата на вакансию к группе риска Как нейтрализовать пагубное влияние сотрудников группы риска на организацию. Как безболезненно избавиться от сотрудников, составляющих группу риска. Меры снижения риска, связанного с психологическими особенностями поведения работников.	1. Демпфирование поведенческого риска 2. способы подготовки предпринимателя к познанию конкурентов по бизнесу. 3. Классификация абстрактных типов собеседников. 4. вербальная характеристика и описание качественного метода идентификации и измерения природного риска в предпринимательстве. 5. основные способы измерения риска. 6. Содержание статистического метода определения вероятностей рисков событий. 7. Применение метода «дерева событий» при измерении риска. 8. распределения рисков в предпр-льской деятельности? 9. Применение статистического способа определения вероятностных характеристик риска в финансовой сфере. 10. О метод последовательного анализа Вальда и классический метод Неймана-Пирсона.	4	2
Тема 2.2. Управление инвестиционным и рисками	Определение максимального уровня риска с помощью графика Лоренца. Расчет индекса риска по формуле П.П. Маслова. Метод анализа величины относительных рисков. Модель Монте-Карло. Анализ чувствительности модели. Метод экспертных оценок. Выбор видов рисков, определение их приоритетности и суммарного балла. Расчет уровня риска до и после проведения компенсационных мероприятий. Необходимость расчетов экономической инвестиции. Показатели эффективности и методика их расчета с поправкой на риск. Содержание метода аналогий и его использование при анализе рисков нового проекта. Содержание метода анализа сценариев. Использование анализа «дерева решений» при долгосрочных инвестициях.	Семинарское занятие: 1. Информация для измерения уровня предпринимательского риска. 2. ведущие факторы риска? 3. различие в системе доверия менеджеров к информации о рисках 4. Методология идентификации экономических рисков. 5. задачи технического анализа рынка ценных бумаг. 6. содержание инерционной стратегии технического анализа? 7. принципы фундаментального анализа рынка ценных бумаг.	6	2
Тема 2.3. Принятие управленческих решений в условиях риска	Характеристика основных финансовых документов как источника данных о рисках фирмы. Общая характеристика приемов анализа финансовой отчетности. Основы коэффициентного анализа рисков позиции корпорации. Анализ показателей платёжеспособности и	Семинарское занятие: 1. Классификация рисков. 2. Формы и обстоятельства проявления рисков. 3. Отображение формализованных результатов	6	2

Наименование раздела, темы дисциплины	Содержание разделов дисциплины	Содержание семинарских/практических занятий		
			Кол-во часов	
			О	З
1	2	3	4	5
	ликвидности деятельности корпорации. Анализ и оценка рисков акционеров. Механизмы повышения лояльности к держателям акционерного капитала в современных экономических условиях.	масштабирования рисков? 4. Системность в классификации экономических рисков? 5. Факторы анализа рисков. 6. Природа немотивированного риска.		

5. Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

5.1. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы студентов по дисциплине

1. Управление рисками: конспект лекций для студентов курса образовательного уровня «магистр» направления подготовки 38.04.04 «Государственное и муниципальное управление» (профиль: «Управление проектами», «Инновационный проектный менеджмент») очной и заочной формы обучения / сост. А.И. Ярембаш. – (в электронном виде на дисковом носителе). Рассмотрен на заседании кафедры ИМиУП, протокол №1 от 28.08.2017 г.

2. Управление рисками: методические рекомендации для проведения семинарских занятий для студентов образовательного уровня «бакалавр» направления подготовки 38.04.04 «Государственное и муниципальное управление» (профиль: «Управление проектами», «Инновационный проектный менеджмент») очной и заочной формы обучения / сост. А.И. Ярембаш - (в электронном виде на дисковом носителе). Рассмотрены на заседании кафедры ИМиУП, протокол №1 от 28.08.2017 г.

3. Управление рисками: методические рекомендации для самостоятельной работы студентов образовательного уровня «бакалавр» направления подготовки 38.04.04 «Государственное и муниципальное управление» (профили: «Управление проектами», «Инновационный проектный менеджмент»), очной и заочной формы обучения / сост. А.И. Ярембаш – (в электронном виде на дисковом носителе). Рассмотрены на заседании кафедры ИМиУП, протокол №1 от 28.08.2017 г.

Перечень вопросов для самоподготовки

1. Сущность категории «риск».
2. Значение учета фактора риска в производственно-хозяйственной деятельности компании.
3. Управление рисками. Риск- менеджмент, его функции.
4. Классификация инновационных рисков.
5. Производственно-технические риски.
6. Риск банкротства.
7. Области риска.
8. Риски усиления конкуренции.
9. Аналитический метод анализа риска.
10. Метод «дерева решений», аналогий, метод оценки риска по прямым капитальным вложениям

5.2. Перечень основной учебной литературы

1. Балдин, К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. – М.: Дашков и К, 2012. - 418 с.

2. Балдин, К. В. Управление рисками [Электронный ресурс] : учебное пособие / Балдин К. В. - Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2012. - 512 с. – Режим доступа: ЭБС Ай Пи Ар Букс.
3. Мамаева, Л.Н. Управление рисками: учебное пособие / Л.Н. Мамаева. – М.: Дашков и К, 2012. – 255 с.1. Управление закупками и поставками / М.Р. Линдерс. – Москва: Юнити-Дана, 2013. – 751 с.;

5.3. Перечень дополнительной литературы

1. Авдошин, С.М. Информатизация бизнеса. Управление рисками / С.М. Авдошин, Е.Ю. Песоцкая. - М.: ДМК Пресс, 2011. - 176 с.
2. Алексеенко В. Б. Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия: учебно-методическое пособие / Алексеенко В. Б. – Москва : Российский университет дружбы народов, 2013. – 88 с. – Режим доступа: ЭБС IPRbooks.
3. Воробьев С.Н. Управление рисками в предпринимательстве / С.Н. Воробьев, К.В. Балдин. – М.: Дашков и К, 2013. – 481 с.
4. Домашенко, Д.В. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Д.В. Домашенко, Ю.Ю. Финогенова. - М.: Магистр, ИНФРА-М, 2010. - 238 с.
5. Леонович, Т.И. Управление рисками в банковской деятельности: Учебный комплекс / Т.И. Леонович. - Минск: Дикта, Мисанта, 2012. - 136 с.
6. Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах: Учебное пособие / А.И. Новиков, Т.И. Солодка. - М.: Дашков и К, 2013. - 288 с. – Режим доступа: ЭБС Ай Пи Ар Букс.
7. Плошкин, В.В. Оценка и управление рисками на предприятиях: Учебное пособие / В.В. Плошкин. - Ст. Оскол: ТНТ, 2013. - 448 с.
8. Рыхтикова, Н.А. Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие / Н.А. Рыхтикова. - М.: Форум, 2012. - 240 с.
9. Стребел, П. Грамотные ходы. Как умные стратегия, психология и управление рисками обеспечивают успех бизнеса / П. Стребел, Э. Олссон; Пер. с англ. А. Столяров. - М.: Олимп-Бизнес, 2013. - 208 с.
10. Тепман Л. Н. Управление банковскими рисками [Электронный ресурс] : учебное пособие / Тепман Л. Н. - Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2013. - 311 с. – Режим доступа: ЭБС Ай Пи Ар Букс.
11. Уродовских, В.Н. Управление рисками предприятия: учебное пособие. Гриф УМО / В.Н. Уродовских. - М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2012. - 168 с.
12. Федорова, Т.А. Управление рисками и страхование в туризме: Учебное пособие / Т.А. Федорова. - М.: Магистр, НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 192 с.

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

- <http://www.mos.ru> (Официальный сервер Правительства Москвы)
- <http://www.duma.mos.ru> (Официальный сайт Московской городской Думы)
 - <http://www.amom.ru> (Официальный сайт Совета Муниципальных образований города Москвы)
 - www.emsu.ru (Сайт для профессионалов местного самоуправления)
 - www.eo.zelao.ru (Сайт «Электронный округ»)

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

- ППП MS Office Project

7.1. Перечень информационных технологий (при необходимости)

Реализация учебной дисциплины предполагает:

- наличие учебных кабинетов (аудиторий) и лабораторий, оснащенных мультимедийным оборудованием, выходом в интернет, видеотехникой и акустическими системами, обеспечивающими возможности проведения учебных занятий студентов в дистанционном формате,
- использование электронных презентаций, электронного курса лекций, графических объектов, видео-аудио-материалов, виртуальных лабораторий или практикумов, специализированных или офисных программ, организация взаимодействия с обучающимися посредством электронной почты, форумов, интернет-групп, скайпа, чатов, видеоконференцсвязи, вебинаров, компьютерное тестирование, дистанционные занятия, подготовка проектов с использованием электронного офиса.

7.2. Перечень программного обеспечения (при необходимости)

Для успешного освоения дисциплины, студент использует следующие программные средства:

- Microsoft Word
- Microsoft Excel
- Microsoft PowerPoint

8. Фонд оценочных средств для контроля уровня сформированности компетенций

8.1. Виды промежуточной аттестации

Текущий контроль успеваемости позволяет оценить уровень сформированности элементов компетенций (знаний и умений), компетенций с последующим объединением оценок и проводится в форме устного опроса (фронтальный, индивидуальный, комплексный), письменной проверки (ответы на вопросы, тестовые задания), включая задания для самостоятельной работы.

Промежуточная аттестация по итогам освоения дисциплины в форме зачета, позволяет оценить уровень сформированности компетенций и может осуществляться по результатам текущего контроля и итоговой контрольной работы, тестовых заданий и т.п.

Промежуточная аттестация в форме экзамена позволяет оценить уровень сформированности компетенций в целом по дисциплине и может осуществляться как в письменной так и в устной форме.

8.2. Показатели и критерии оценки результатов освоения дисциплины

Средним баллом за дисциплину является средний балл за текущую учебную деятельность. Механизм конвертации результатов изучения студентом дисциплины в оценки по государственной шкале и шкале ECTS представлен в таблице.

Средний балл по дисциплине (текущая успеваемость)	Отношение полученного студентом среднего балла по дисциплине к максимально возможной величине этого показателя	Оценка по государственной шкале	Оценка по шкале ECTS	Определение
4,5 – 5,0	90% – 100%	5	A	отлично – отличное выполнение с незначительным количеством неточностей (до 10%)
4,0 – 4,49	80% – 89%	4	B	хорошо – в целом

				правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 20%)
3,75 – 3,99	75% – 79%	4	C	хорошо – в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 25%)
3,25 – 3,74	65% – 74%	3	D	удовлетворительно – неплохо, но со значительным количеством недостатков (до 35%)
3,0 – 3,24	60% – 64%	3	E	достаточно – выполнение удовлетворяет минимальные критерии, но со значительным количеством недостатков (до 40%)
до 3,0	35% – 59%	2	FX	неудовлетворительно с возможностью повторной сдачи (ошибок свыше 40%)
	0 – 34%	2	F	неудовлетворительно – надо поработать над тем, как получить положительную оценку (ошибок свыше 65%)

8.3. Критерии оценки работы студента

При усвоении каждой темы за текущую учебную деятельность студента выставляются оценки по 5-балльной (государственной) шкале. Оценка за каждое задание в процессе текущей учебной деятельности определяется на основе процентного отношения операций, правильно выполненных студентом во время выполнения задания:

- 90-100% – «5», 75-89% – «4», 60-74% – «3», менее 60% – «2».

Если на занятии студент выполняет несколько заданий, оценка за каждое задание выставляется отдельно.

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

Примерный перечень вопросов к экзамену по курсу дисциплины «Управление рисками»:

1. Сущность категории «риск».
2. Значение учета фактора риска в производственно-хозяйственной деятельности компании.
3. Управление рисками. Риск- менеджмент, его функции. Стратегия управления рисками.
4. Чистые, спекулятивные, фундаментальные риски.
5. Политические риски, их виды.
6. Природно-естественные риски.
7. Классификация инновационных рисков.
8. Производственно-технические риски.
9. Финансовые риски. Кадровые риски.
10. Таможенные риски. Моральный риск.
11. Криминальные риски, связанные с преступлениями в экономической сфере.
12. Чистые, спекулятивные, фундаментальные риски.

13. Политические риски, их виды.
14. Природно-естественные риски.
15. Классификация инновационных рисков.
16. Производственно-технические риски.
17. Финансовые риски. Кадровые риски.
18. Таможенные риски. Моральный риск.
19. Криминальные риски, связанные с преступлениями в экономической сфере.
20. Риск банкротства.
21. Области риска.
22. Система рисков в производственной деятельности. Виды рисков в производственной деятельности.
23. Риски не востребоваемости производственной продукции. Классификационные факторы риска не востребоваемости продукции.
24. Риски неисполнения хозяйственных договоров.
25. Риски усиления конкуренции.
26. Риск, связанный с изменением удельного веса постоянных затрат в операционных затратах предприятия.
27. Форс-мажорные риски.
28. Аналитический метод анализа риска.
29. Метод «дерева решений», аналогий, метод оценки риска по прямым капитальным вложениям
30. Необходимость расчетов экономической инвестиции. Показатели эффективности и методика их расчета с поправкой на риск.
31. Способы снижения (нейтрализации) рисков
32. Принятие решения об отказе от риска.
33. Разделение рисков, объединение рисков.
34. Трансферт риска.
35. Аренда, лизинг, факторинг.
36. Виды диверсификации предпринимательской деятельности.
37. Резервирование средств на покрытие непредвиденных расходов.
38. Использование страхования в управлении рисками.
39. Хеджирование рисков.
40. Прогнозирование банкротства.
41. Программа управления рисками.
42. Область неопределенности и степень триска.
43. Точка и параметры риска.
44. Консервативный и прогрессивный подход к определению рисков.
45. Операционные и финансовые риски.
46. Профиль рисков, фиксация и документирование.

Контрольные работы

Проведение контрольных работ необходимо для выяснения полноты усвоения основного содержания пройденных тем и умения использовать теоретический материал для решения практических задач. Промежуточные контрольные работы предусматривают выполнение заданий по пройденным темам.

Методические рекомендации по выполнению контрольной работы

Контрольные работы позволяют выяснить полноту усвоения содержания пройденных тем. Поэтому после проведения контрольных работ результаты на последующих практических или семинарских занятиях обсуждаются. Возможна также корректировка на последующих занятиях, повторение тех вопросов, которые на недостаточном уровне усвоили студенты.

Контрольные вопросы и задачи составлены с учетом ключевых проблем и вопросов, глубокие знания которых необходимы для полноты усвоения предмета в целом. Контрольные работы проводятся в форме постановочных вопросов и задач.

Работа считается зачетной в том случае, если она отвечает определенным требованиям:

- правильно использован изученный теоретический и аналитический материал по дисциплине;
- найдены правильные варианты ответов;
- способность сформулировать причинно-следственную связь вопроса и ответа;
- аргументировано сформулировать зависимость теории и практики в управлении риском;
- содержит достоверный материал;
- соответствует правилам оформления.

Оценка "неудовлетворительно" ставится, если работа полностью не отвечает требованиям к данному виду зачетных работ студентов.

Контрольная работа не может быть оценена положительно, если в ней поверхностно раскрыты вопросы, допущены принципиальные ошибки, а также при условии механически переписанного материала из учебников или другой литературы. В случае неудовлетворительной оценки контрольная работа направляется студенту для повторного выполнения. К повторно выполненной работе необходимо приложить первую редакцию.

Контрольная работа №1 по теме 1; подготовка и защита эссе по теме «Классификация рискованных ситуаций»

Методические указания по подготовке и защите эссе

Эссе (небольшая письменная работа), выполняется по указанной теме и предполагает анализ природы и классификации риска. Наиболее подробно тема «Понятие риска. Классификация рискованных ситуаций» изложена в книге Г. В. Черновой, А. А. Кудрявцева «Управление рисками». Содержание эссе должно быть последовательным и аргументированным.

Структура эссе (с учётом всех особенностей и специфики вопроса), как правило, должна включать в себя следующие смысловые элементы:

- введение или вступление, в котором анализируется значение и место раскрываемого вопроса;
- основная часть, посвящённая изложению известных студенту сведений по заданному вопросу, в том числе анализу практических аспектов управления
- заключение, в котором подводятся итоги изложенного материала, высказывается индивидуальная позиция студента по заданному вопросу.
- список использованных нормативных правовых документов, источников и литературы, иллюстрированных материалов.

Объём эссе в текстовом виде не должен превышать 5-7 страниц. Эссе сдается преподавателю в установленный срок.

Контрольная работа №2. Творческое задание по теме 4.

Задание для выполнения контрольной работы

Используя национальный стандарт РФ «Менеджмент риска. Методы оценки риска», разработанный Федеральным агентством по техническому регулированию и метрологии (ГОСТ Р ИСО/МЭК 31010- 2011), составить таблицу соотношений между различными методами оценки риска и существенными факторами риска в конкретной ситуации и привести примеры выбора метода оценки риска для конкретной ситуации.

Контрольная работа №3. Решение задач.

Задание для выполнения контрольной работы

На практике в финансовом менеджменте для оценки «рискованности» отдельных операций часто используют упрощенные коэффициентные методы определения риска, например, с помощью коэффициента риска K_p :

$$K_p = \frac{Y}{C},$$

где Y – максимально возможная величина убытка от проводимой операции в ходе коммерческой или биржевой деятельности;

C – объем собственных финансовых ресурсов с учетом точно известных поступлений средств, руб.

Шкала оценки риска

Оценка риска	Значение K_p
Минимальный риск	0-0,1
Допустимый риск	0,1-0,3
Высокий риск	0,3-0,6
Недопустимый риск	более 0,6

Задача 1.

Предприниматель оценивает вариант вложения финансовых ресурсов объема $C = 72\ 000$ руб. Прогнозная оценка возможного убытка $Y = 24\ 000$ руб. Оценить последствия риска предпринимательской операции.

Решение:

В соответствии с формулой $K_p = \frac{Y}{C}$, значение коэффициента равно 0,3, что соответствует предельному значению зоны допустимого риска. Целесообразность данной операции определяется ожидаемой величиной прибыли.

Задача 2.

Коммерческому банку «София» предстоит принять решение о целесообразности кредитования ОАО «Синяя птица» Согласно бухгалтерской отчетности фактическое значение коэффициента текущей ликвидности у этого предприятия равно 1,6.

Банк ведет статистику неплатежей, в соответствии с которой у конкурентов, оказывающихся должниками, коэффициент находится в диапазоне 0,9:1,8, а у аккуратных плательщиков – в диапазоне 1,2:2,7.

Определить вероятность невыполнения заемщиком договорных обязательств и оценить степень кредитного риска.

Решение:

Для данного предприятия зона риска по значению коэффициента текущей ликвидности можно рассчитать так:

$$P(x) = \frac{x-a}{b-a},$$

где b – верхняя граница зоны риска;

a – нижняя граница зоны риска;

x – фактическое значение $K_{\text{тл}}$.

В нашем случае $a=1,2$; $b=1,8$; $x=1,6$. В соответствии с формулой вероятность невозврата долга:

$$P(x) = \frac{1,8 - 1,2}{1,8 - 1,2} = 0,33, \text{ или } 33\%$$

что соответствует высокому уровню риска.

Если бы у «Софии»-банка не было представительской статистики неплатежей, то расчет уровня риска кредитования в соответствии с рекомендациями дол бы следующие результаты: $a=1,0$; $b=2,0$; $x=1,6$.

$$4. P(x) = \frac{2,0 - 1,0}{2,0 - 1,0} = 0,40, \text{ или } 40\%$$

т.е. порог уровня риска при детализации информации уменьшается.

Задача 3.

Компания «Российский сыр» – производитель кисломолочных продуктов и сыра на экспорт. Один из продуктов, сырная паста, поставляется в страны ближнего зарубежья. Генеральный директор должен решить: сколько ящиков сырной пасты следует производить в течение месяца. Вероятность того, что спрос на сырную пасту в течение месяца будет 6, 7, 8 или 9 ящиков равна 0,1, 0,3, 0,5 и 0,1.

Затраты на производство 1 ящика равны 45

у.е. Компания продает 1 ящик по цене 95 у.е.

Если ящик сырной пасты не продается в течение месяца, то она портится – компания не получает дохода. Определить: сколько ящиков производить?

Решение:

Спрос	6 ящиков	7 ящиков	8 ящиков	9 ящиков	Средняя ожидаемая прибыль
Производство ящиков					
6 ящиков	300	300	300	300	300
7 ящиков	255	350	350	350	340,5
8 ящиков	210	305	400	400	352,5
9 ящиков	165	260	355	450	317
Вероятность	0,1	0,3	0,5	0,1	

Средняя ожидаемая прибыль:

$$6 \text{ ящиков} = 300 \cdot 0,1 + 300 \cdot 0,3 + 300 \cdot 0,5 + 300 \cdot 0,1 = 300,0 \text{ у.е.}$$

$$7 \text{ ящиков} = 255 \cdot 0,1 + 350 \cdot 0,3 + 350 \cdot 0,5 + 350 \cdot 0,1 = 340,5 \text{ у.е.}$$

$$8 \text{ ящиков} = 210 \cdot 0,1 + 305 \cdot 0,3 + 400 \cdot 0,5 + 400 \cdot 0,1 = 352,7 \text{ у.е.} - \text{оптимальный вариант}$$

$$9 \text{ ящиков} = 165 \cdot 0,1 + 260 \cdot 0,3 + 355 \cdot 0,5 + 450 \cdot 0,1 = 317,0 \text{ у.е.}$$

Задача 4.

Имеются следующие данные о количестве и ценах угля, необходимого для отопления дома. Цена угля летом 6 у.е. за 1 тонну.

При наступлении зимы:

Зима	Количество угля, т	Средняя цена за 1 т, у.е.
Мягкая	4	7
Обычная	5	7,5
Холодная	6	8

Объем хранения 6 тонн.

Вероятность мягкой, обычной или холодной зим: 0,35, 0,5 и 0,15 соответственно.

Вероятность	0,35	0,5	0,15	Средний расход угля
Зима	Мягкая	Обычная	Холодная	
Мягкая	24 [4*6]	31,5 [4*6+7.5]	40 [4*6+2*8]	
Обычная	30 [5*6]	30 [5*6]	38 [5*6+8]	
Холодная	36 [6*6]	36 [6*6]	36 [6*6]	

Примеры тестовых вопросов:

1. Под экономическим риском понимается риск, возникающий при:

1. Любых видах предпринимательской деятельности
2. Коммерческой деятельности
3. Производственной активности
4. Банковской деятельности

2. Если перед руководством предприятия существует вероятность потери или неполучение прибыли в краткосрочном периоде, тогда говорят о:

1. Издержки обращения
2. Рисковую ситуацию
3. Неопределенность
4. Альтернативный вариант решения, принимаемого

3. До основных моментов, характеризующих рисковую ситуацию, не относится:

1. Случайный характер события
2. Наличие альтернативных решений
3. Наличие бизнес-плана
4. Вероятность возникновения убытков
5. Нет ответов

4. Вероятность потерь, возникающих при вложении средств в производство нового товара – это:

1. Инновационный риск
2. Технический риск
3. Отраслевой риск
4. Производственный риск

5. Под управлением рисками понимается:

1. Действия по определению приемлемого уровня риска для фирмы и направлений снижения действий риска, что для фирмы недопустимы
2. Особый вид деятельности, направленный на смягчение воздействия риска на конечные результаты деятельности фирмы
3. Методический инструментарий оценки и учета риска
4. Нет ответов

6. К функциям риска не относится:

1. Инновационная
2. Регулятивная
3. Защитная
4. Стимулирующая

7. Понятие “риск” характеризует ситуацию:

1. Когда наступление события невероятно
2. Когда наступление негативного события вероятно и может быть оценено количественно и качественно
3. Когда оценить качество и вероятность события осложнено внешними факторами
4. Когда существует опасность потенциальной потери ресурсов

8. При анализе риска используют следующие критерии:

1. Потери от риска не зависят друг от друга, допустимый уровень риска должен быть ниже суммы расчетной прибыли

2. Потери по одному из направлений портфеля рисков не обязательно увеличивают вероятность потери по другому
3. Максимально возможный ущерб не должен превышать финансовых возможностей предприятия; потери от действия рисков не зависят друг от друга
4. Потери от риска не зависят друг от друга, допустимый уровень риска должен быть ниже суммы расчетной прибыли и потери по одному из направлений портфеля рисков не обязательно увеличивают вероятность потери по другому

9. Риски могут быть идентифицированы в процессе анализа бухгалтерской и статистической информации называются:

1. Известными рисками
2. Предусмотренными рисками
3. Непредвиденными рисками
4. Статистическими рисками

10. Степень допустимого риска определение с учетом параметров:

1. Основные фонды, объем производства, объем реализации, показатели рентабельности
2. Оценка правового, экономического, политического среды
3. Профиля деятельности фирмы, отношение к рискам партнеров по бизнесу; конкурентоспособности предприятия, рентабельности
4. Нет ответов

11. Критерий оценки риска (К) рассчитывается по следующей формуле:

1. $K = f \times (X_{пл} - X_{ф})$
2. $K = f \times (X_{пл} / X_{ф})$
3. $K = f / (X_{пл} - X_{ф})$
4. $K = f + (X_{пл} - X_{ф})$

Где f – вероятность возникновения потерь; $X_{пл}$, $X_{ф}$ – планируемое, фактическое значение показателю

12. К методам оценки и учета риска не относится:

1. статистический
2. экспертное
3. балансовый
4. расчетно-аналитический

13. К внешним источникам риска не относят:

1. появление эффективных товаров - замінювачів
2. технологические новшества
3. потери рабочего времени
4. модификация процентной ставки за кредит

14. Статистический метод оценка риска не включает:

1. Метод статистических испытаний
2. Построение графика Лоренцу
3. Среднеквадратического отклонения и коэффициента вариации
4. Анализ целесообразности затрат
5. Анализ чувствительности модели

Примерные темы рефератов (студент вправе согласовать с преподавателем иную тему):

1. Проблемы выбора между централизованным и децентрализованными способами

- закупок.
2. Инструменты открытости и прозрачности закупок для обеспечения государственных и муниципальных нужд в ДНР. Эффективность применения.
 3. Контрактная служба государственного заказчика: полномочия и ответственность.
 4. Дополнительные задачи контрактной системы как инструмента воздействия на экономику.
 5. Проблемы привлечения квалифицированных подрядчиков к выполнению работ для государственных нужд.
 6. Описание объекта закупки для государственных и муниципальных нужд и защита конкуренции.
 7. Проблемы планирования закупок и риски «зарегулированности».
 8. Перспективы нормирования закупок в ДНР.
 9. Опыт общественного обсуждения закупок в ДНР.
 10. Методы обоснования начальной (максимальной) цены контракта и их применение в ДНР.
 11. Проблемы выбора критериев оценки заявок на участие в конкурсе и их коррупциогенность.
 12. Двойная юрисдикция бюджетных учреждений при закупке товаров, работ и услуг. Проблемы выбора.
 13. Виды аукционов в мировой практике. Место аукциона в электронной форме в системе аукционов.
 14. Риски неэффективного определения поставщика по результатам проведения аукциона в электронной форме в ДНР.
 15. Запрос предложений как новый способ закупки. Проблемы и практика применения.
 16. Изменения в регулировании проведения запроса котировок. Ожидаемые последствия: преимущества и недостатки.
 17. Особенности осуществления закупок путем проведения запроса котировок в целях оказания гуманитарной помощи либо ликвидации последствий чрезвычайных ситуаций природного или техногенного характера.
 18. Особенности закупки энергосервисных работ.
 19. Понятие контракта. Отличительные особенности от договора.
 20. Сравнительная характеристика способов обеспечения исполнения контракта. Обоснование выбора одного из способов с точки зрения наибольшей защиты интересов заказчика.
 21. Односторонний отказ от исполнения контракта: преимущества и недостатки.
 22. Проблемы привлечения к административной ответственности за правонарушения в сфере закупок товаров, работ, услуг для обеспечения государственных и муниципальных нужд.
 23. Виды контроля в сфере закупок товаров, работ, услуг для обеспечения государственных и муниципальных нужд. Проблемы дублирования функций различных органов.
 24. Реестр недобросовестных поставщиков как инструмент воздействия на рынок госзаказа.
 25. Проблемы обжалования действий (бездействия) заказчика, уполномоченного органа, уполномоченного учреждения, специализированной организации, комиссии по осуществлению закупок, ее членов, должностного лица контрактной службы, контрактного управляющего, оператора электронной площадки.

9. Методические рекомендации (указания) для обучающихся по освоению дисциплины

Приступая к изучению дисциплины, студенту необходимо внимательно ознакомиться с тематическим планом занятий, списком рекомендованной научной литературы. Следует уяснить последовательность выполнения индивидуальных учебных заданий.

Самостоятельная работа студента предполагает работу с научной и учебной литературой, умение создавать тексты, устанавливать контакты и взаимодействия с различными социальными группами, профессионально участвовать в подготовке и проведении анализов, получать необходимую информацию в ходе опросов.

Уровень и глубина усвоения дисциплины зависят от активной и систематической работы на практических занятиях, изучения рекомендованной литературы, выполнения контрольных письменных заданий.

При изучении дисциплины студенты выполняют следующие задания: изучают рекомендованную научно-практическую литературу; пишут контрольные работы, готовят доклады и сообщения к практическим занятиям; участвуют в выполнении практических заданий.

Рекомендации:

1. Освоение программы курса предполагает использование новейших достижений экономической мысли и анализа, изучение разработок различных исследовательских центров, трудов отдельных авторов и коллективных сборников трудов, новой научной и учебной литературы.

2. В ходе преподавания курса дисциплины могут быть использованы многочисленные публикации в специализированных изданиях, порталы, фонды специализированных библиотек.

3. В качестве доступного источника информации могут быть использованы: специализированные веб-сайты; информационные ресурсы – сайты агентств, фондов, центров и др.

4. Зарубежные ресурсы представлены сайтами исследовательских центров и университетских кафедр. *Специальные журналы и Интернет - СМИ* - обширный источник информации. *Информационные сайты и базы данных* - полнотекстовая Университетская информационная система «РОССИЯ».

Библиотеки – в них представлены электронные полнотекстовые библиотеки каталоги публичных библиотек России, по которым легко найти необходимое издание.

4. Данный курс имеет ярко выраженную практическую направленность, поэтому при освоении содержания данной дисциплины очень большое внимание должно быть уделено не только получению необходимого минимума знаний, но и практическому освоению многих специфических навыков и умений в области исследования

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

Освоение дисциплины «Управление командой проекта» предполагает использование академических аудиторий, соответствующих действующим санитарным противопожарным правилам и нормам. Аудитории, в которых проходят лекционные и практические занятия по данной дисциплине, оснащены необходимым мультимедийным оборудованием, а также компьютерной техникой, обеспечивающей, в том числе, возможность выхода в Интернет. Оборудование учебного кабинета (аудитории) и рабочих мест кабинета: рабочие учебные столы, доски SMART Board 660, мультимедиа проекторы, компьютеры. Установленное лицензионное программное обеспечение ППП MS Office Project.

Компьютеры (с процессором не ниже Pentium IV, текстовым редактором Microsoft Word, операционной системой Windows XP, 2.66 ГГц, 1Гб оперативной памяти, 250 Гб жёсткий диск) активно используются в целях интенсификации учебного процесса, активизации познавательной деятельности студентов в ходе изучения отдельных тем дисциплины. Для создания и демонстрации компьютерных презентаций применяется приложение PowerPoint. Для проведения тестирования по отдельным темам курса используется раздаточный печатный материал.