

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:
ФИО: Костина Лариса Николаевна
Должность: проректор
Дата подписания: 10.12.2024 01:46:42
Уникальный программный ключ:
1800f7d89cf4ea7507265ba593fe87537eb15a6c

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
"ДОНЕЦКАЯ АКАДЕМИЯ УПРАВЛЕНИЯ И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ"

Факультет

Государственной службы и управления

Кафедра

Инновационного менеджмента и управления проектами

"УТВЕРЖДАЮ"

Проректор



Л.Н. Костина

27.04.2023 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.15

"Управление рисками и изменениями"

Направление подготовки 38.04.04 Государственное и муниципальное управление
Профиль "Государственное регулирование внешнеэкономической и проектной деятельности"

Квалификация

МАГИСТР

Форма обучения

очная

Общая трудоемкость

3 ЗЕТ

Год начала подготовки по учебному плану

2023

Составитель(и):

д-р техн. наук, профессор

 И.В. Антипов

Рецензент(ы):

д-р. гос. упр, профессор

 Е.В. Пономаренко

Рабочая программа дисциплины (модуля) "Управление рисками и изменениями" разработана в соответствии с:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.04 Государственное и муниципальное управление (приказ Минобрнауки России от 13.08.2020 г. № 1000)

Рабочая программа дисциплины (модуля) составлена на основании учебного плана Направление подготовки 38.04.04 Государственное и муниципальное управление

Профиль "Государственное регулирование внешнеэкономической и проектной деятельности", утвержденного Ученым советом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС" от 27.04.2023 протокол № 12.

Срок действия программы: 2023-2025

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Инновационного менеджмента и управления проектами

Протокол от 18.04.2023 № 11

Заведующий кафедрой:

канд.гос.упр., доцент, Морозов Е.Л.


(подпись)

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году**"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2024 - 2025 учебном году на заседании кафедры Инновационного менеджмента и управления проектами

Протокол от " ____ " _____ 2024 г. №__

Зав. кафедрой канд.гос.упр., доцент, Морозов Е.Л.

(подпись)

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году**"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2025 - 2026 учебном году на заседании кафедры Инновационного менеджмента и управления проектами

Протокол от " ____ " _____ 2025 г. №__

Зав. кафедрой канд.гос.упр., доцент, Морозов Е.Л.

(подпись)

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году**"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2026 - 2027 учебном году на заседании кафедры Инновационного менеджмента и управления проектами

Протокол от " ____ " _____ 2026 г. №__

Зав. кафедрой канд.гос.упр., доцент, Морозов Е.Л.

(подпись)

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году**"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2027 - 2028 учебном году на заседании кафедры Инновационного менеджмента и управления проектами

Протокол от " ____ " _____ 2027 г. №__

Зав. кафедрой канд.гос.упр., доцент, Морозов Е.Л.

(подпись)

РАЗДЕЛ 1. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ

1.1. ЦЕЛИ ДИСЦИПЛИНЫ	
Целью учебной дисциплины «Управление рисками» является обеспечение фундаментальной и практической профессиональной подготовки обучающихся в области теории и практики управления рисками, а также освоения методов оценки результативности системы управления рисками.	
1.2. УЧЕБНЫЕ ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ	
обеспечить формирование системы знаний о современной концепции управления рисками в организациях, сформированных на корпоративных правах и бюджетной основе.	
1.3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОСНОВНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ	
Цикл (раздел) ОПОП ВО:	Б1.В
<i>1.3.1. Дисциплина "Управление рисками и изменениями" опирается на следующие элементы ОПОП ВО:</i>	
Инновационный менеджмент	
Управление проектами	
<i>1.3.2. Дисциплина "Управление рисками и изменениями" выступает опорой для следующих элементов:</i>	
Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы	
Преддипломная практика	
1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:	
<i>ПК-7.4: Способен применять совокупность знаний, практик, инструментов и методов, необходимых для идентификации и управления рисками и возможностями проектов (программ) в целях успешного получения результатов, достижения показателей и цели проекта (программы), реагирования на трансформацию и отклонения различных параметров проекта (программы)</i>	
Знать:	
Уровень 1	современные методы анализа информации, методику ее проведения, принципы критической оценки информации, передовой опыт конструктивных решений в профессиональной сфере
Уровень 2	основные документы нормативно-правовой базы принятия управленческих решений с учетом конституционно-правовых основ управления, базовых правовых категорий государственного управления, применяемых в действующем законодательстве
Уровень 3	на совершенстве нормативно-правовую базу принятия управленческих решений с учетом конституционно-правовых основ управления, базовых правовых категорий государственного управления, применяемых в действующем законодательстве
Уметь:	
Уровень 1	оценивать некоторые альтернативные точки зрения, выявлять основные тенденции развития социально-экономических процессов, разрабатывать критический обзор накопленной информации
Уровень 2	оценивать большинство альтернативных точек зрения, выявлять основные тенденции развития социально-экономических процессов, разрабатывать критический обзор накопленной информации
Уровень 3	оценивать все альтернативные точки зрения, выявлять основные тенденции развития социально-экономических процессов, разрабатывать критический обзор накопленной информации
Владеть:	
Уровень 1	некоторыми навыками применения современных методов анализа информации
Уровень 2	большинством навыков применения современных методов анализа информации
Уровень 3	всеми навыками применения современных методов анализа информации
<i>В результате освоения дисциплины "Управление рисками и изменениями" обучающийся</i>	
3.1	Знать:
	- современные методы анализа информации, методику ее проведения, принципы критической оценки информации, передовой опыт конструктивных решений в профессиональной сфере;
	- нормативно-правовую базу принятия управленческих решений с учетом конституционно-правовых основ управления, базовых правовых категорий государственного управления, применяемых в действующем законодательстве;
3.2	Уметь:

	- оценивать альтернативные точки зрения, выявлять основные тенденции развития социально-экономических процессов, разрабатывать критический обзор накопленной информации;
	- вырабатывать и принимать управленческие решения;
3.3 Владеть:	
	- навыками применения современных методов анализа информации;
	- навыками принятия управленческих решений.
1.5. ФОРМЫ КОНТРОЛЯ	
Текущий контроль успеваемости позволяет оценить уровень сформированности элементов компетенций (знаний, умений и приобретенных навыков), компетенций с последующим объединением оценок и проводится в форме: устного опроса на лекционных и семинарских/практических занятиях (фронтальный, индивидуальный, комплексный), письменной проверки (тестовые задания, контроль знаний по разделу, ситуационных заданий и т.п.), оценки активности работы обучающегося на занятии, включая задания для самостоятельной работы.	
Промежуточная аттестация	
Результаты текущего контроля и промежуточной аттестации формируют рейтинговую оценку работы студента. Распределение баллов при формировании рейтинговой оценки работы студента осуществляется в соответствии с действующим локальным нормативным актом. По дисциплине "Управление рисками и изменениями" видом промежуточной аттестации является Экзамен	

РАЗДЕЛ 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

2.1. ТРУДОЕМКОСТЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ						
Общая трудоёмкость дисциплины "Управление рисками и изменениями" составляет 3 зачётные единицы, 108 часов.						
Количество часов, выделяемых на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающегося, определяется учебным планом.						
2.2. СОДЕРЖАНИЕ РАЗДЕЛОВ ДИСЦИПЛИНЫ						
Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Примечание
Раздел 1. Идентификация рисков						
Тема 1.1.Риск как экономическая категория /Лек/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2	0	
Тема 1.1.Риск как экономическая категория /Сем зан/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Э1 Э2	0	
Тема 1.1.Риск как экономическая категория /Ср/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .2 Э1 Э2	0	
Тема 1.2. Неопределенность и риск /Лек/	4	4	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2	0	
Тема 1.2. Неопределенность и риск /Сем зан/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1	0	

				Э1 Э2		
Тема 1.2. Неопределенность и риск /Ср/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .2 Э1 Э2	0	
Тема 1.3. Методологические основы анализа риска /Лек/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2	0	
Тема 1.3. Методологические основы анализа риска /Сем зан/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Э1 Э2	0	
Тема 1.3. Методологические основы анализа риска /Ср/	4	6	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .2 Э1 Э2	0	
Раздел 2. Оценка рисков и управление ими						
Тема 2.1.Методы оценки рисков /Лек/	4	4	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2	0	
Тема 2.1.Методы оценки рисков /Сем зан/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Э1 Э2	0	
2 /Ср/	4	6	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .2 Э1 Э2	0	
Тема 2.2.Методы минимизации рисков /Лек/	4	4	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2	0	
Тема 2.2.Методы минимизации рисков /Сем зан/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Э1 Э2	0	
Тема 2.2.Методы минимизации рисков /Ср/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .2 Э1 Э2	0	
Тема 2.3. Управление рисками /Лек/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2	0	

Тема 2.3. Управление рисками /Сем зан/	4	6	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Э1 Э2	0	
Тема 2.3. Управление /Ср/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .2 Э1 Э2	0	
Раздел 3. Управление изменениями						
Тема 3.1. Теоретические основы управления изменениями /Лек/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2	0	
Тема 3.1. Теоретические основы управления изменениями /Сем зан/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Э1 Э2	0	
Тема 3.1. Теоретические основы управления изменениями /Ср/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .2 Э1 Э2	0	
Тема 3.2 Эффективность изменений /Лек/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2	0	
Тема 3.2 Эффективность изменений /Сем зан/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Э1 Э2	0	
Тема 3.2 Эффективность изменений /Ср/	4	3	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .2 Э1 Э2	0	
Тема 3.3. Организационное развитие /Лек/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1 Э1 Э2	0	
Тема 3.3. Организационное развитие /Сем зан/	4	4	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Э1 Э2	0	
Тема 3.3. Организационное развитие /Ср/	4	6	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .2	0	

				Э1 Э2		
Консультация /Конс/	4	2	ПК-7.4	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Л3.2 Э1 Э2	0	

РАЗДЕЛ 3. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Технология контекстного обучения – обучение в контексте профессии (реализуется в учебных заданиях, учитывающих специфику направления и профиля подготовки). Технология интерактивного обучения (реализуется в форме учебных заданий, предполагающих взаимодействие обучающихся, использование активных форм обратной связи).

Технология электронного обучения (реализуется при помощи электронной образовательной среды ГОУ ВПО «ДОНАУИГС» и при использовании ресурсов ЭБС, при проведении автоматизированного тестирования и т. д.).

РАЗДЕЛ 4. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

4.1. Рекомендуемая литература

1. Основная литература			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	А. И. Ярембаш	Управление рисками : конспект лекций для студентов 2 курса ОУ «магистр» направления подготовки 38.04.04 «Государственное и муниципальное управление» (магистерские программы : «Инновационный и проектный менеджмент», «Управление проектами») очной / заочной форм обучения (132 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2018
Л1.2	Таскаева, Н. Н., Прохорова, Ю. С.	Антикризисное управление и риск-менеджмент : учебно-методическое пособие (47 с.)	Москва : Издательство МИСИ – МГСУ, 2020
2. Дополнительная литература			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Сорокин, Л. В.	Управление рисками международных проектов: учебное пособие (64 с.)	Москва : РУДН, 2019
3. Методические разработки			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	А. И. Ярембаш	Управление рисками и изменениями: методические рекомендации для проведения семинарских занятий для обучающихся образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.04 Государственное и муниципальное управление (магистерская программа «Управление проектами») очной / заочной форм обучения (40 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2021
Л3.2	А. И. Ярембаш	Управление рисками и изменениями: методические рекомендации по организации самостоятельной работы обучающихся образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.04 Государственное и муниципальное управление (магистерская программа «Управление проектами») очной / заочной форм обучения (40 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2021
4.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"			
Э1	Научная электронная библиотека КиберЛенинка	https://cyberleninka.ru	
Э2	Научная электронная библиотека	elibrary.ru	

4.3. Перечень программного обеспечения

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства:

Компьютерная техника с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду (ЭИОС ГОУ ВПО ДОНАУИГС) и электронно-библиотечную систему (ЭБС IPRbooks), а также возможностью индивидуального неограниченного доступа обучающихся в ЭБС и ЭИОС посредством Wi-Fi с персональных мобильных устройств.

Сервер: AMD FX 8320/32Gb(4x8Gb)/4Tb(2x2Tb). На сервере установлена свободно распространяемая операционная система DEBIAN 10. MS Windows 8.1 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК), MS Windows XP (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК), MS Windows 7 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК), MS Office 2007 Russian OLP NL AE (лицензии Microsoft № 42638778, № 44250460), MS Office 2010 Russian (лицензии Microsoft № 47556582, № 49048130), MS Office 2013 Russian (лицензии Microsoft № 61536955, № 62509303, № 61787009, № 63397364), Grub loader for ALT Linux (лицензия GNU LGPL v3), Mozilla Firefox (лицензия MPL2.0), Moodle (Modular Object-Oriented Dynamic Learning Environment, лицензия GNU GPL), IncScape (лицензия GPL 3.0+), PhotoScape (лицензия GNU GPL), 1С ERP УП, 1С ЗУП (бес-платные облачные решения для образовательных учреждений от 1Cfresh.com), OnlyOffice 10.0.1 (SaaS, GNU Affero General Public License3).

4.4. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы:

Электронный каталог изданий ГОУ ВПО "ДОНАУИГС" - <http://unilib.dsum.internal/>

Научная электронная библиотека «КИБЕРЛЕНИНКА» - <https://cyberleninka.ru/>

Донецкая республиканская универсальная научная библиотека им. Н. К. Крупской - <http://www.lib-dpr.ru/>

Научная электронная

библиотека eLIBRARY.RU -<http://elibrary.ru/defaultx.asp>

Электронная библиотека Института проблем рынка РАН Российской академии наук (ИПР РАН) – <http://www.ipr-ras.ru/libr.htm>;

ГУК "Донецкая республиканская универсальная научная библиотека им. Н.К. Крупской";

ЧОУ ВО "Курский институт менеджмента, экономики и бизнеса";

ФГБОУ ВО "Уральский государственный экономический университет".

4.5. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, текущего контроля и про-межуточной аттестации № 604 учебный корпус № 1.

- комплект мультимедийного оборудования: экран для проектора (переносной), мультимедийный проектор (переносной) Epson H311B LCD Projector, ноутбук Samsung RV408 (NP-RV408-A01UA) (Экран 14» (1366x768) LED, глянцевый / Intel Celeron Dual Core T3500 (2.1 ГГц) / RAM 2 Гб / HDD 250 Гб / Intel GMA 4500M / DVD Super Multi / LAN / Wi-Fi / веб-камера / DOS) с установленным ПО (Windows 8.1 Professional x86/64 (академическая подписка DreamSpark Premium), LibreOffice 4.3.2.2 (лицензия GNU LGPL v3+ и MPL2.0)), подключением к Интернет и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду ГОУ ВПО «ДОНАУИГС»);

- специализированная мебель: рабочее место преподавателя, рабочие места обучающихся (80), стационарная доска, доска передвижная;

- учебно-наглядные пособия, демонстрационные плакаты.

Помещения для самостоятельной работы с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно образовательную среду организации:

Читальный зал № 1, аудитория 406 учебный корпус № 1. Адрес: г. Донецк, ул. Челюскинцев 163а; Читальный зал № 2, аудитория 323, 324 учебный корпус № 6. Адрес: г. Донецк, ул. Артема 94.

РАЗДЕЛ 5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

5.1. Контрольные вопросы и задания

Вопросы для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации:

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 невостребованности производственной продукции. Классификационные факторы риска невостребованности 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.
47. Цели и задачи управленческой деятельности в области управления изменениями.
48. Ключевые положения об изменениях для организации.
49. Характеристика основных изменений организации.
50. Классификация изменений.

5.2. Темы письменных работ

Примерные темы рефератов

1. Эволюция взглядов на категории «риск».
2. Выбор инвестиционного портфеля в условиях неопределенности и риска.
3. Предпосылки и факторы, предшествующие наступлению рисковых ситуаций.
4. Сущность и содержание риск-менеджмента.
5. Анализ и оценка уровня риска.
6. Методы уклонения от риска и его компенсации.
7. Методы управления финансовым риском.
8. Классификация рисков.
9. Роль Банка России в управлении банковскими рисками.
10. Способы снижения процентного и кредитного риска.
11. Понятие и классификация рисков в страховом бизнесе.
12. Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR).
13. Организация управления риском на производственном предприятии.
14. Метод статистических испытаний (Monte-Carlo simulation).

15. Хеджирование рисков.
16. Управление кредитным риском в деятельности банков.
17. Статистические методы оценки риска.
18. Критерий ожидаемой полезности.
19. Риски в международной банковской деятельности.
20. Этапы управления риском.
21. Аутсорсинг управления риском.
22. Методы финансирования рисков.
23. Пороговые значения риска.
24. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.
25. Идентификация и анализ рисков.
26. Меры по предотвращению неплатежеспособности и несостоятельности российских предприятий.
27. Реструктуризация предприятия: подходы и решения.
28. Правовое регулирование отношений в сфере несостоятельности (банкротства).
29. Анализ результатов развития предприятия в условиях быстро меняющейся внешней среды.
30. Пути реструктуризации предприятия с учетом зарубежного опыта.
31. Взгляды экономистов на теорию циклов и кризисов.
32. Методы антирискового регулирования экономики.
33. Причины, факторы и симптомы кризисного развития экономики.
34. Диагностика банкротства предприятий.
35. Зарубежная практика риск-менеджмента.
36. Основные стратегии вывода предприятия из кризиса.
37. Классификация антикризисных стратегий.
38. Меры по восстановлению платежности должника.
39. Выбор оптимального объема производства в условиях неопределенности спроса.
40. Институциональные особенности принятия решений в переходной экономике.
41. Стратегия и тактика риск-менеджмента

5.3. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств дисциплины "Управление рисками и изменениями" разработан в соответствии с локальным нормативным актом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС".

Фонд оценочных средств дисциплины "Управление рисками и изменениями" в полном объеме представлен в виде приложения к данному РПД.

5.4. Перечень видов оценочных средств

Деловая и/или ролевая игра, кейс-задача, коллоквиум, контрольная работа, круглый стол, дискуссия, полемика, диспут, дебаты, портфолио, рабочая тетрадь, разноуровневые задачи и задания, расчетная работа, реферат, доклад, сообщение, эссе

РАЗДЕЛ 6. СРЕДСТВА АДАПТАЦИИ ПРЕПОДАВАНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ К ПОТРЕБНОСТЯМ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

В случае необходимости, обучающимся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья (по заявлению обучающегося) могут предлагаться одни из следующих вариантов восприятия информации с учетом их индивидуальных психофизических особенностей:

1) с применением электронного обучения и дистанционных технологий.

2) с применением специального оборудования (техники) и программного обеспечения, имеющихся в ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС".

В процессе обучения при необходимости для лиц с нарушениями зрения, слуха и опорно-двигательного аппарата предоставляются следующие условия:

- для лиц с нарушениями зрения: учебно-методические материалы в печатной форме увеличенным шрифтом; в форме электронного документа; в форме аудиофайла (перевод учебных материалов в аудиоформат); индивидуальные задания и консультации.

- для лиц с нарушениями слуха: учебно-методические материалы в печатной форме; в форме электронного документа; видеоматериалы с субтитрами; индивидуальные консультации с привлечением сурдопереводчика; индивидуальные задания и консультации.

- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата: учебно-методические материалы в печатной форме; в форме электронного документа; в форме аудиофайла; индивидуальные задания и консультации.

РАЗДЕЛ 7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО УСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Аудиторные занятия по дисциплине проводятся в форме лекций и семинарских занятий.

На лекционных занятиях, согласно учебному плану дисциплины, обучающимся предлагается рассмотреть основные темы курса. Лекция должна быть записана студентом, однако, форма записи может быть любой (конспект, схематичное фиксирование материала, запись узловых моментов лекции, основных терминов и определений). Возможно выделение (подчеркивание, выделение разными цветами) важных понятий, положений. Это поможет обучающимся развить не только слуховую, но и зрительную память.

Не следует записывать все, многие факты, примеры, детали, раскрывающие тему лекции, можно дополнительно просмотреть в учебной литературе, рекомендуемой преподавателем.

Помимо внимательного прослушивания материала, без переключения на посторонние детали, студенту предлагается участвовать в диалоге с преподавателем, в ходе которого могут обсуждаться моменты, актуальные для его будущей практической деятельности; он может высказать свое мнение после сопоставления разных фактов и разнообразных точек зрения на них.

К числу важнейших умений, являющихся неотъемлемой частью успешного учебного процесса, относится умение работать с различными литературными источниками, содержание которых так или иначе связано с изучаемой дисциплиной.

Подготовку к любой теме курса рекомендуется начинать с изучения конспекта лекций. В лекциях дается систематизированное изложение материала, разъясняется смысл разных терминов в общественно-трудовых правоотношениях и сообщается об изменениях в подходах к изучению тех или иных проблем данного курса.

Методические указания по организации самостоятельной работы

Самостоятельная работа по дисциплине организована в следующих видах:

- поиск и обзор научных публикаций и электронных источников информации, подготовка заключения по обзору;
- конспектирование первоисточников и учебной литературы;
- анализ статистических и фактических материалов, составление выводов на основе проведенного анализа;
- анализ проблемных ситуаций;
- подготовка докладов выступлений на семинарских занятиях, на конференции;
- выполнение индивидуального задания;
- работа с вопросами для самопроверки и тестами.

Результаты самостоятельной работы является написание рефератов, докладов, сообщений по конкретной тематике учебной дисциплины и выполнение индивидуального задания, которые контролируются преподавателем и учитываются при текущей аттестации студента.

Реферат, эссе. Реферат должен содержать основные фактические сведения и выводы по рассматриваемому вопросу. Требования к оформлению: шрифт Times New Roman – 14; междустрочный интервал 1,5; первая строка - отступ – 1,25; выравнивание текста по ширине.

Содержание реферата обычно включает в себя:

- введение, в котором обосновывается актуальность выбранной темы;
- основную часть, раскрывающую тему через выделение в ней 3-4 аспектов, которые надо сформулировать как отдельные пункты (главы);
- заключение, где подводятся итоги проделанной автором работы;
- список литературы, в котором должно быть не менее 5 наименований.

При написании реферата необходимо пользоваться учебниками, справочной литературой, а также обязательным является использование книг, статей из периодических изданий. Библиографический поиск следует начать со знакомства с литературой, рекомендованной к теме учебного курса, близкой к выбранной теме контрольной работы. Объем реферата должен составлять 5-7 страниц. Содержание основной части реферата предполагает осмысленное и логичное изложение главных положений и идей, содержащихся в изученной литературе. В тексте обязательны ссылки на первоисточники.

В заключении излагаются выводы, сделанные студентом в соответствии с целями и задачами, заявленными в исследовании, а также в случае целесообразности, рекомендации, которые вытекают из предмета исследования и могут быть использованы в практике государственного и муниципального управления.

Список использованной литературы и источников включает в себя реально использованную в ходе написания реферата литературу и должен быть оформлен согласно правилам библиографического описания.

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ДОНЕЦКАЯ АКАДЕМИЯ УПРАВЛЕНИЯ И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ»

Факультет государственной службы и управления
Кафедра инновационного менеджмента и управления проектами

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

«Управление рисками и изменениями»

Направление подготовки	38.04.04 Государственное и муниципальное управление
Профиль	Государственное регулирование внешнеэкономической и проектной деятельности
Квалификация	магистр
Форма обучения	очная
Год начала подготовки по учебному плану	2023
Авторы	доцент, канд.гос.упр., доцент Е.Л. Морозов

Донецк
2023

Фонд оценочных средств «Управление рисками и изменениями» для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.04 Государственное и муниципальное управление (профиль «Государственное регулирование внешнеэкономической и проектной деятельности») очной форм обучения

Автор(ы),

разработчик(и): _____ профессор кафедры ИМиУП, д-р техн. наук, профессор И.В.Антипов

должность, ученая степень, ученое звание, инициалы и фамилия

РАЗДЕЛ 1.
ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
по учебной дисциплине
«Управление рисками и изменениями»

1.1. Основные сведения об учебной дисциплине

Таблица 1

Характеристика учебной дисциплины

Образовательная программа	магистратура
Направление подготовки	38.04.04 «Государственное и муниципальное управление»
Профиль	Государственное регулирование внешнеэкономической и проектной деятельности
Количество разделов учебной дисциплины	3
Часть образовательной программы	Часть, формируемая участниками образовательных отношений
Формы текущего контроля	Тестовые, практические и ситуационные задания, реферат, контроль знаний по разделам
<i>Показатели</i>	Очная форма обучения
Количество зачетных единиц (кредитов)	4
Семестр	3
Общая трудоемкость (академ. часов)	144
Аудиторная контактная работа:	48
Лекционные занятия	24
Семинарские занятия	24
Самостоятельная работа	69
Контроль	27
<i>Форма промежуточной аттестации</i>	Экзамен

1.2. Перечень компетенций с указанием этапов формирования в процессе освоения образовательной программы.

Таблица 2

Перечень компетенций и их элементов

Код компетенции	Формулировка компетенции	Элементы компетенции	Индекс элемента
ПК-7.4	Способен применять совокупность знаний, практик, инструментов и методов, необходимых для идентификации и управления рисками и возможностями проектов (программ) в целях успешного получения результатов, достижения показателей и цели проекта (программы), реагирования на трансформацию и отклонения различных параметров проекта (программы)	Знать	
		основные методы сбора и анализа информации для принятия управленческих решений	ПК-7.4
		методику ее оценки, принципы критической оценки информации, передовой опыт конструктивных решений в соответствующей сфере.	ПК-7.4
		Уметь:	
		применять основные методы выработки решений с учетом антиконфликтологического подхода	ПК-7.4

		применять основные научные аспекты управления, связанные с наилучшей практикой хозяйственной деятельности	ПК-7.4
		анализировать и обобщать информацию, логически мыслить, проявлять самостоятельность суждений и проводить анализ потребностей и интересов членов коллектива и учитывать их при принятии управленческих решений	ПК-7.4
		оценивать альтернативные точки зрения, выявлять основные тенденции развития социально-экономических процессов, разрабатывать критический обзор накопленной информации	ПК-7.4
		Владеть:	
		навыками принятия управленческих решений в кризисных и конфликтных ситуациях	ПК-7.4
		техникой принятия конструктивных решений на базе анализа и синтеза, способностью формировать критический подход к полученной информации, приемами ее достоверной оценки	ПК-7.4

Таблица 3

Этапы формирования компетенций в процессе освоения основной образовательной программы

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Этапы формирования компетенций (номер семестра)	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства*
Раздел 1. Идентификация рисков				
1.	Тема 1.1. Риск как экономическая категория	8	ПК-7.4	Устный опрос, ситуационные задания
2.	Тема 1.2. Неопределенность и риск	8	ПК-7.4	Устный опрос, практические и ситуационные задания
3.	Тема 1.3. Методологические основы анализа риска	8	ПК-7.4	Устный опрос, (доклад), контроль знаний по разделу 1 (тестовые задания)
Раздел 2. Оценка рисков и управление ими				
4.	Тема 2.1. Методы оценки рисков	8	ПК-7.4	Устный опрос, ситуационные задания
5.	Тема 2.2. Методы минимизации рисков	8	ПК-7.4	Устный опрос, ситуационные задания, реферат (доклад)
6.	Тема 2.3. Управление рисками	8	ПК-7.4	Ситуационные задания, реферат (доклад), контроль знаний по разделу 2 (тестовые задания)
Раздел 3. Управление изменениями				

7	3.1. Теоретические основы управления изменениями		ПК-7.4	Устный опрос, ситуационные задания, реферат (доклад)
8	3.2. Эффективность изменений		ПК-7.4	Устный опрос, ситуационные задания, реферат (доклад)
9	3.3. Организационное развитие		ПК-7.4	Ситуационные задания, реферат (доклад), контроль знаний по разделу 3 (тестовые задания)

1.3. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах формирования, описание шкалы оценивания.

Таблица 4

Дескриптор компетенции	Показатель оценки	Шкалы оценивания			Критерии оценивания
		Государственная	Баллы	ECTS	
1	2	4	5	6	7
Знает	ПК-7.4	Отлично	90-100	А	теоретическое содержание дисциплины освоено полностью, без пробелов; необходимые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы, все предусмотренные рабочей программой дисциплины задания выполнены, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к максимальному
Умеет	ПК-7.4				
Владеет	ПК-7.4				
Знает	ПК-7.4	Хорошо	75-89	В/С	теоретическое содержание дисциплины освоено полностью, без пробелов; некоторые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы недостаточно, все предусмотренные рабочей программой дисциплины задания выполнены, качество выполнения ни одного из них не оценено минимальным числом баллов, некоторые виды заданий выполнены с ошибками
Умеет	ПК-7.4				
Владеет	ПК-7.4				
Знает	ПК-7.4	Удовлетворительно	60-74	D/E	теоретическое содержание дисциплины освоено частично, но пробелы не носят существенного характера; необходимые практические навыки работы с освоенным материалом в основном сформированы, большинство предусмотренных рабочей программой дисциплины учебных задания выполнено, некоторые из выполненных заданий содержат ошибки
Умеет	ПК-7.4				
Владеет	ПК-7.4				
Не знает	ПК-7.4	Неудовлетворительно	0-59	F/ Fх	теоретическое содержание дисциплины не освоено полностью; необходимые практические навыки работы не сформированы, все предусмотренные рабочей программой дисциплины задания выполнены с грубыми ошибками либо совсем не выполнены, качество их выполнения оценено числом баллов, близким к минимальному
Не умеет	ПК-7.4				
Не владеет	ПК-7.4				

РАЗДЕЛ 2 Текущий контроль

Текущий контроль знаний используется для оперативного и регулярного управления учебной деятельностью (в том числе самостоятельной работой) обучающихся. В условиях балльно-рейтинговой системы контроля результаты текущего оценивания обучающегося используются как показатель его текущего рейтинга. Текущий контроль успеваемости осуществляется в течение семестра, в ходе повседневной учебной работы по индивидуальной инициативе преподавателя. Данный вид контроля стимулирует у обучающегося стремление к систематической самостоятельной работе по изучению учебной дисциплины.

В условиях балльно-рейтинговой системы контроля результаты текущего оценивания обучающегося используются как показатель его текущего рейтинга. Текущий контроль успеваемости осуществляется в течение семестра, в ходе повседневной учебной работы по индивидуальной инициативе преподавателя. Данный вид контроля стимулирует у обучающегося стремление к систематической самостоятельной работе по изучению учебной дисциплины.

Распределение баллов по рейтинговой системе оценивания по видам учебной деятельности (очная форма обучения)

Сумма баллов по разделу	Раздел 1				Раздел 2				Раздел 3			Научная составляющая	Сумма баллов за дисциплину	
Темы	Т. 1.1	Т. 1.2	Т. 1.3	Контроль знаний раздела 1	Т. 2.1	Т. 2.2	Т. 2.3	Контроль знаний раздела 2	Т. 3.1	Т. 3.2	Т. 3.3			Контроль знаний раздела 3
Виды работ: Лекции					Контроль знаний раздела 1					Контроль знаний раздела 2				
Семинарские занятия	4	4	4	8		4	8	8	4		4			
Индивидуальные задания (эссе / компьютерная презентация)	4	4	4	4		4	4	4	4		4			
Самостоятельная работа														
Сумма баллов	24			6	24			6	24			6	10	10

2.1. Описание оценочных средств по видам заданий текущего контроля

2.1.1. Рекомендации по оцениванию устных ответов обучающихся

С целью контроля и подготовки обучающихся к изучению новой темы вначале каждого семинарского занятия преподавателем проводится индивидуальный или фронтальный устный опрос по выполненным заданиям предыдущей темы.

Критерии оценки:

правильность ответа по содержанию задания (учитывается количество и характер ошибок при ответе);

полнота и глубина ответа (учитывается количество усвоенных фактов, понятий и т.п.);

сознательность ответа (учитывается понимание излагаемого материала);

логика изложения материала (учитывается умение строить целостный, последовательный рассказ, грамотно пользоваться специальной терминологией);

рациональность использованных приемов и способов решения поставленной учебной задачи (учитывается умение использовать наиболее прогрессивные и эффективные способы достижения цели);

своевременность и эффективность использования наглядных пособий и технических средств при ответе (учитывается грамотно и с пользой применять наглядность и демонстрационный опыт при устном ответе);

использование дополнительного материала (обязательное условие);

рациональность использования времени, отведенного на задание (не одобряется растянутость выполнения задания, устного ответа во времени, с учетом индивидуальных особенностей обучающихся).

Оценка «5» - 4 балла - ставится, если обучающийся:

1) полно и аргументировано отвечает по содержанию задания;

2) обнаруживает понимание материала, может обосновать свои суждения, применить знания на практике, привести необходимые примеры не только по учебнику, но и самостоятельно составленные;

3) излагает материал последовательно и правильно;

Оценка «4» - 3 балла - ставится, если обучающийся дает ответ, удовлетворяющий тем же требованиям, что и для оценки «5», но допускает 1-2 ошибки, которые сам же исправляет.

Оценка «3» - 2 балл - ставится, если обучающийся обнаруживает знание и понимание основных положений данного задания, но:

1) излагает материал неполно и допускает неточности в определении понятий или формулировке правил;

2) не умеет достаточно глубоко и доказательно обосновать свои суждения и привести свои примеры;

3) излагает материал непоследовательно и допускает ошибки.

Оценка «2» - 1 балл - ставится, если обучающийся обнаруживает незнание ответа на соответствующее задание, допускает ошибки в формулировке определений и правил, искажающие их смысл, беспорядочно и неуверенно излагает материал. Оценка «2» отмечает такие недостатки в подготовке обучающегося, которые являются серьезным препятствием к успешному овладению последующим материалом.

Вопросы для самоподготовки

Контролируемые разделы (темы) учебной дисциплины	Вопросы для подготовки к индивидуальному / фронтальному устному / письменному опросу по темам дисциплины
Раздел 1. Основы риск-менеджмента	

Тема 1.1. Риск как экономическая категория	<ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие риска, его основные элементы и черты 2. Классификация рисков 3. Факторы, обуславливающие уровень риска 4. Риск-менеджмент: цели, задачи, функции 5. Этапы процесса управления риском 6. Основные способы воздействия на риск
Тема 1.2. Неопределенность и риск	<ol style="list-style-type: none"> 1. Сущность и виды неопределенности в экономике 2. Факторы неопределенности и риска 3. Нестабильность, неопределенность и риск 4. Причины возникновения и измерение неопределенности и риска 5. Методы учета неопределенности и оценки рисков 6. Факторы, влияющие на возникновение рискованных ситуаций.
Тема 1.3. Методологические основы анализа риска	<ol style="list-style-type: none"> 1. Учет неопределенности в подходах к анализу рисков 2. Общие принципы анализа при организации процесса управления риском 3. Основные методы выявления риска 4. Количественные и качественные параметры анализа риска 5. Методы оценки вероятности неблагоприятных событий
Раздел 2. Оценка рисков и управление ими	
Тема 2.1. Методы оценки рисков	<ol style="list-style-type: none"> 1. Теоретические аспекты оценки риска. 2. Статистические методы оценки риска. 3. Аналитические методы оценки риска. 4. Метод экспертных оценок. 5. Метод аналогов
Тема 2.2. Методы минимизации рисков	<ol style="list-style-type: none"> 1. Теоретические аспекты минимизации риска. 2. Методы уклонения от риска. 3. Методы локализации риска. 4. Методы распределения риска. 5. Методы передачи риска. 6. Методы компенсации риска.
Тема 2.3. Управление рисками	<ol style="list-style-type: none"> 1. Сущность и содержание управления риском 2. Система управления рисками 3. Цели и задачи разработки программы управления рисками 4. Описание возможных принципов управления рисками, учитываемых при разработке ПУР 5. методы минимизации риска в зависимости от объекта воздействия 6. Метод минимизации риска – избежание риска 7. Метод– лимитирование концентрации риска 8. Метод – хеджирование 9. Метод – диверсификация 10. Метод – избежание риска
Раздел 3. Управление изменениями	
Тема 3.1. Теоретические основы управления изменениями	<ol style="list-style-type: none"> 1. Необходимость изменений 2. Классификация изменений 3. Этапы процесса изменений 4. Тенденции и закономерности развития организации 5. Системные свойства организации 6. Понятие и содержание организационных изменений. 5. Теории организационных изменений

	6. Модели организационных изменений
Тема 3.2 Управление изменениями в	1. Понятие и этапы изменения системы управления 2. Организационный анализ предприятия и выбор модели организационной структуры 3. Организационные изменения на основе процессного подхода к управлению 4. Виды реорганизации предприятий 5. Механистические организационные структуры 6. Органические организационные структуры 7. последовательность этапов реструктуризации компании
Тема 3.3. Подходы, модели и инструменты управления изменениями	1. Подходы и модели управления организационными изменениями 2. Управление качеством, как инструмент организационных изменений 3. Инструменты проведения организационных изменений 4 Мониторинг и контроль процесса изменений

2.2 Рекомендации по оцениванию результатов тестирования обучающихся

В завершении изучения каждой темы учебной дисциплины проводится тестирование. Его можно провести на бланке.

Критерии оценивания. Уровень выполнения текущих тестовых заданий оценивается в баллах, которые затем переводятся в оценку. Баллы выставляются следующим образом:
правильное выполнение задания, где надо выбрать один верный ответ – 0,5 балла;
Оценка соответствует следующей шкале:

Оценка (государственная)	Баллы	% правильных ответов
Отлично	9-10	90-100
Хорошо	7-8	75-89
Удовлетворительно	5-6	60-74
Неудовлетворительно	0-4	Менее 60

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля создается только для тех видов текущего оценивания, которые заявлены в РПУД для контроля результатов освоения отдельных разделов / тем учебной дисциплины. Примеры оформления заданий для текущего контроля представлены в следующих приложениях.

ТЕСТОВЫЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ

Выберите один правильный вариант ответа

Раздел 1. Основы риск-менеджмента

1) Риск – это:

- а) неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток;
- б) все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка;
- в) вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий;
- г) вероятность провала программы продаж;

2) Управление риском – это:

- а) отказ от рискованного проекта;
- б) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска;
- в) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него;
- г) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска.

- 3) Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя:
- а) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска;
 - б) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска;
 - в) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности;
 - г) умение ликвидировать такие последствия.
- 4) Содержательная сторона риск-менеджмента включает в себя:
- а) планирование деятельности по реализации рискованного проекта;
 - б) сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска;
 - в) выбор мер по минимизации или устранению последствий риска;
 - г) организация службы управления рисками на предприятии.
- 5) Что из перечисленного не является элементом системы риск-менеджмента?
- а) разработка планов, позволяющих действовать оптимальным образом в ситуации риска;
 - б) разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий;
 - в) учет психологического восприятия рискованных проектов;
 - г) все перечисленное является элементами системы риск-менеджмента.
- 6) Какие категории задач риск-менеджмента можно выделить?
- а) применение риск-менеджмента;
 - б) применение методов риск-менеджмента;
 - в) управление рисками по их типам;
 - г) точность оценок рисков; д) точность прогнозов рисков.
- 7) Главной функцией риск-менеджмента является:
- а) создание чуткой системы управления рисками;
 - б) оценка риска по каждому проекту в компании;
 - в) оценка риска для компании в целом;
 - г) предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий.
- 8) Какие подходы выделяют при расчете VAR?
- а) эмпирический;
 - б) логический;
 - в) оценочный;
 - г) параметрический.
- 9) Что из перечисленного не является элементом расчета VAR для одного актива?
- а) текущая стоимость актива;
 - б) чувствительность стоимости к неблагоприятному изменению фактора риска;
 - в) изменение стоимости в перспективе;
 - г) возможное изменение фактора риска при данном доверительном уровне;
- 10) Волатильность – это:
- а) изменчивость рыночного спроса;
 - б) постоянство рыночного спроса;
 - в) изменчивость курсовых разниц и процентных ставок;
 - г) постоянство курсовых разниц и процентных ставок.
- 11) Суть риск-менеджмента состоит в:
- а) устранении риска;
 - б) управлении риском;
 - в) снижении риска;
 - г) выборе риска.
- 12) Каковы функции объекта управления в риск-менеджменте?
- а) организация разрешения риска;
 - б) организация работы по снижению величины риска;
 - в) организация процесса страхования рисков;

- е) все перечисленное является функциями объекта управления;
- 13) Что из перечисленного не является функциями субъекта управления в риск-менеджменте?
- а) прогнозирование;
 - б) организация;
 - в) распределение;
 - г) контроль.
- 14) Что из перечисленного является правилами риск-менеджмента?
- а) нельзя рисковать многим ради малого;
 - б) нельзя думать, что существует только одно решение, возможно, есть и другие;
 - в) при существовании нескольких вариантов, следует идти по пути минимально риска;
 - г) положительное решение принимается лишь при отсутствии сомнения.
- 15) 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.

Раздел 2. Оценка рисков и управление ими

1) Прогнозирование внешней экономической обстановки, стратегическое планирование, мониторинг социально-экономической и нормативно-правовой среды, создание системы резервов – все это инструментарий:

- а) методов диссипации риска;
- б) методов компенсации риска;
- в) методов уклонения от риска;
- г) методов локализации риска.

2) При использовании метода «Сокращение риска» покрытие убытка происходит за счет:

- а) нестрахового пула;
- б) резервов;
- в) спонсора;
- г) государственной поддержки.

3) При использовании метода «Передача риска» покрытие убытка происходит за счет:

- а) самострахования;
- б) займа;
- в) резервов;
- г) страхования.

4) При покрытии убытка из текущего дохода происходит ли на предприятии создание каких-либо фондов?

- а) да;
- б) нет;
- в) фонды могут быть созданы по решению руководства предприятия.

5) Примером покрытия ущерба за счет передачи ответственности на основе договора является:

- а) хеджирование;
- б) кэптиновые страховые организации;
- в) нестраховой пул;
- г) самострахование.

б) При покрытии убытка на основе поддержки государственных либо муниципальных органов к специфическим рискам относят:

- а) риски, связанные с внешнеэкономической деятельностью;

б) риски, связанные с массовым разрушением собственности;

в) риск изменения цен на товары.

7) К покрытию убытка на основе страхования прибегают в следующих случаях:

а) инвестирование средств страховых фондов в пределах одной деловой единицы;

б) сохранение прибыли внутри соответствующей группы;

в) получение льгот по налогообложению (которые могут быть предусмотрены в ряде стран);

г) если существуют большие совокупности рисков, вероятность реализации которых велика, а суммы предполагаемого ущерба небольшие.

8) Основным недостатком кэптивных компаний является:

а) использование этого инструмента возможно только после возникновения ущерба;

б) возможность получения покрытия только незначительного ущерба;

в) в случае ущерба кэптивной компании, он распределяется между всеми участниками.

9) При выборе метода покрытия убытка за счет использования займа особое внимание следует уделить исследованию:

а) величины текущих денежных потоков организации;

б) ликвидности и возвратности займа; в) порогового значения вероятного ущерба.

10) Кэптивная компания – это:

а) нестраховая компания;

б) другое название финансово-промышленной группы;

в) это страховая компания, входящая в состав нестраховых организаций;

г) компания-спонсор.

11) Метод покрытия убытков из текущих доходов используют, если:

а) величина убытков не велика;

б) величина убытков велика;

в) это не искажает денежных потоков;

г) организация хочет возложить ответственность за возмещение возможного ущерба на специализированную организацию.

12) Особенностью метода покрытия убытка на основе самострахования является:

а) работа с большим числом однородных рисков;

б) работа только с неоднородными рисками;

в) работа с катастрофическими рисками.

Раздел 3. Управление изменениями

1. В теории управления под «организацией» понимается

1) комплекс действий по приведению какого-либо объекта или системы в работоспособное состояние

2) процесс распределения функций и задач между сотрудниками, обеспечение их взаимодействия при выполнении работы для достижения целей фирмы или группы

3) формально образованное для достижения определенных целей объединение людей, являющихся частью структуры общества

4) группа людей, не имеющих общих целей и определенных функций

2. Признаки системы, присущие социальной организации:

1) неделимость

2) наличие множества элементов

3) единство главной цели для всех элементов

4) самостоятельное, не связанное целеполагание разных элементов организационной системы

5) полная независимость элементов организации как системы

6) наличие связей между элементами организации

3. Основные принципы организации:

1) равновесия, сохранения и развития, и взаимозаменяемости и взаимозависимости

- 2) предсказуемости, определенности, самоопределения
- 3) примата цели, формы и содержания, взаимосвязи и взаимодействия
- 4) единомыслия, сплоченности, конфликтности
4. К внешней среде организации относятся:
 - 1) конкуренты организации
 - 2) сотрудники организации
 - 3) поставщики материальных ресурсов
 - 4) налоговая инспекция
 - 5) услуги организации, реализуемые на определенном региональном рынке
 - 6) тактика рыночной деятельности организации
5. К внутренней среде организации относятся:
 - 1) бизнес-партнеры организации
 - 2) материальные ресурсы организации
 - 3) поставщики материальных ресурсов
 - 4) вышестоящая организация
 - 5) стратегия рыночной деятельности организации
 - 6) технологии производства, примеряемые в организации
6. Жизненный цикл организации – это модель, описывающая
 - 1) этапы развития организации во времени и характерные для них проблемы
 - 2) этапы технологических производственных циклов, характерных для организации
 - 3) этапы смены династий рабочих и менеджеров, работающих в организации, и возникающие при этом проблемы
7. Суть модели жизненного цикла организации Л.Грейнера заключается в следующем:
 - 1) На протяжении всего жизненного цикла организации должен сохраняться единый неизменный стиль управления ею
 - 2) каждая фаза цикла характеризуется периодами развития, роста, стабилизации и кризиса
 - 3) каждый период роста требует разных стилей управления организацией
 - 4) каждая фаза цикла представляет собой часть единого поступательного бескризисного процесса развития
8. Согласно теории И.Адизеса наиболее значимыми параметрами жизнедеятельности организации, обеспечивающими ее процветание, являются
 - 1) размер организации и стратегическое планирование
 - 2) стабильность и единомыслие
 - 3) контролируемость и гибкость
9. На какой фазе жизненного цикла согласно мнению И.Адизеса для успешного дальнейшего развития необходимо создать эффективную систему управления организацией
 - 1) на фазе «Младенчества»
 - 2) на фазе «Юности»
 - 3) на фазе «Давай-давай» (Go-Go)
 - 4) на фазе «Стабильности»
10. Согласно мнению И.Адизеса, ключевыми ролями менеджеров, обеспечивающих развитие организации, являются
 - 1) администратор, наставник, контролер, коммуникатор
 - 2) защитник, хозяйственник, наставник, амортизатор (гарант стабильности внутренней среды)
 - 3) предприниматель, производитель (гарант обеспечения объемов производства и продаж), администратор, интегратор
11. К организационным изменениям можно отнести
 - 1) смену организационной структуры компании
 - 2) прием на работу новых сотрудников взамен уволившихся из управленческих структур по собственному желанию

3) обучение вновь принятых рабочих установленным в организации технологическим приемам работы

4) освоение рабочими технологии, необходимой для выпуска новой продукции

12. Организационные изменения могут затрагивать следующие элементы:

1) цели и стратегию конкурентов

2) цели и стратегию организации

3) мнения и лояльность потребителей

4) лояльность и патриотизм сотрудников

13. К основным силам, определяющим новую экономику, относят:

1) развитие национальных культур

2) глобализацию

3) возрастание роли информации и интеллектуального капитала

4) развитие аграрного сектора экономик

14. Под проактивными изменениями понимают

1) изменения, направленные на подавление негативной активности персонала

2) изменения, направленные против излишнего спроса на товары

3) изменения, реализуемые заранее для предотвращения негативного влияния среды на организацию

4) изменения, реализуемые в ответ на негативное влияние среды на организацию

15. К личным причинам (барьерам), определяющим сопротивление персонала организационным переменам, относят

1) наличие в организации сложившихся влиятельных коалиций

2) сложности в изменении принятых правил выполнения работ и внутриорганизационного взаимодействия

3) непонимание сотрудниками, от которых зависит успех перемен, своей роли в процессе преобразований

4) перегруженность сотрудников текущей работой и недостаток времени для освоения нового

16. К структурным (организационным) причинам (барьерам), определяющим сопротивление персонала организационным переменам, относят

1) наличие в организации сложившихся влиятельных коалиций

2) сложности в изменении принятых правил выполнения работ и внутриорганизационного взаимодействия

3) непонимание сотрудниками, от которых зависит успех перемен, своей роли в процессе преобразований

4) перегруженность сотрудников текущей работой и недостаток времени для освоения нового

17. Рациональный тип негативного отношения к переменам проявляется в

1) неуверенности в собственных способностях, достаточных для освоения новых требований и объемов работы

2) опасения потерять рабочее место или размеры оплаты труда

3) несогласия с целесообразностью реализации программы изменений для целей компании

4) нежелания менять привычный трудовой коллектив

18. Процесс реализации изменений вызовет меньшее сопротивление персонала, если

1) будет выполняться при постоянном вмешательстве в него приглашенного руководством стороннего консультанта

2) будет проходить под руководством одного из менеджеров компании, пользующегося авторитетом в коллективе

3) отдельные сотрудники будут заранее оповещены о предполагаемых изменениях в компании

4) персонал будет своевременно проинформирован о том, в чем целесообразность изменений и каким образом они коснутся интересов сотрудников

19. Методами преодоления сопротивления персонала изменениям могут быть:

- 1) кооперация и кооптация
- 2) избегание и замалчивание
- 3) вовлеченность или принуждение
- 4) предпринимательство или вмешательство местных властных структур

20. Основные этапы модели организационных изменений К.Левина:

- 1) стабилизация - реализация изменений - активизация
- 2) размораживание – реализация изменений - замораживание
- 3) разогрев – стабилизация – реализация перемен

21. Согласно подходу М.Бира и Н.Нориа стратегия перемен в рамках теории Е реализуется посредством

- 1) стремления главным образом к увеличению экономического результата
- 2) стремления к развитию потенциала организации
- 3) повышения преданности сотрудников своей компании
- 4) преимущественно материального стимулирования персонала

22. Согласно подходу М.Бира и Н.Нориа стратегия перемен в рамках теории О реализуется посредством

- 1) централизованного управления с преобладанием авторитарического стиля
- 2) участия сотрудников компании в разработке управленческих решений
- 3) предварительного планирования работ и процессов и последующего контроля их четкого выполнения

- 4) создания командного духа и экспериментирования

23. В соответствии с моделью организационных преобразований Ф.Ж.Гуиера и Дж.Н.Келли под рефреймингом понимается

- 1) изменение формата общения компании со средствами массовой информации
- 2) изменение видения сущности, философии бизнеса компании
- 3) изменение качества информационных технологий, применяемых компанией для обеспечения бизнеса

24. Согласно теории организационных изменений Л.Грейнера

1) высокая степень участия подчиненных в организационных изменениях не всегда целесообразна и должна быть обоснована

2) организационные перемены следует реализовывать, только опираясь на полное вовлечение в процесс изменений всего персонала компании

3) высокая степень вовлеченности персонала в процесс перемен вредит их успеху

2.3 Рекомендации по оцениванию результатов ситуационных и практических заданий

Максимальное количество баллов	Правильность (ошибочность) решения
7-8	Полные верные ответы. В логичном рассуждении при ответах нет ошибок, задание полностью выполнено. Получены правильные ответы, ясно прописанные во всех строках заданий и таблиц
5-6	Верные ответы, но имеются небольшие неточности, в целом не влияющие на последовательность событий, такие как небольшие пропуски, не связанные с основным содержанием изложения. Задание оформлено не вполне аккуратно, но это не мешает пониманию вопроса
3-4	Ответы в целом верные. В работе присутствуют несущественная хронологическая или историческая ошибки, механическая ошибка или описка, несколько искажившие логическую последовательность ответа

1-2	Ответы неверные или отсутствуют последовательности событий и установлении дат. При объяснении исторических событий и явлений указаны не все существенные факты
0	Ответы неверные или отсутствуют

СИТУАЦИОННЫЕ И ПРАКТИЧЕСКИЕ ЗАДАНИЯ ДЛЯ ПРОВЕРКИ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИИ

Ситуационное задание 1. Выявление рисков

Требуется выявить наиболее значимые риски для данного вида деятельности. Для этого выбирается предприятие (реально действующее или модель). Описание предприятия должно включать в себя следующие данные;

1) название организации; 2) виды деятельности; 3) масштаб деятельности (размер бизнеса); 5) др. данные, которые необходимы.

Постановка задачи: На основе этих сведений необходимо составить список всех возможных рисков, которым подвержено данное предприятие. Каждый риск оценивается с точки зрения вероятности его реализации и возможного ущерба. Рекомендуется выявить не менее 5-10 рисков.

Ситуационное задание 2. Классификация рисков.

Дан следующий перечень рисков. 1) Риск слишком резкого снижения курса валют, для компании, осуществляющей экспортные операции. 2) Риск возникновения сбоев в поставках сырья. 3) Риск снижения спроса на продукцию предприятия. 4) Риск отвержения рынком нового товара организации. 5) Риск потери прибыли в результате снижения рыночных цен на товар. 6) Риск просрочки выплаты долга дебитором. 7) Риск разрушения складского помещения фирмы в результате стихийного бедствия. 8) Риск утечки информации, представляющей коммерческую тайну. 9) Риск возникновения на рынке нового сильного конкурента. 10) Риск потери платежеспособности. 11) Риск превышения спросом производственных мощностей предприятия. 12) Риск поставки низкокачественных материалов поставщиком (с большой долей брака). 13) Риск резкого скачка текучести кадров. 14) Риск остановки производства в результате выхода из строя оборудования. 15) Риск ухода с рынка основного промышленного потребителя продукции предприятия. 16) Риск отказа инвестора от дальнейшего финансирования проекта в процессе его реализации. 17) Риск ухода ведущих специалистов компании.

Практическое задание 1.

Требуется выявить наиболее значимые риски для данного вида деятельности. Для этого выбирается предприятие (реально действующее или модель). Описание предприятия должно включать в себя следующие данные;

- 1) название организации;
- 2) виды деятельности;
- 3) масштаб деятельности (размер бизнеса);
- 4) др. данные, которые студенты посчитают необходимыми.

Постановка задачи: На основе этих сведений необходимо составить опросные листы для выявления и оценки рисков, которым подвержено данное предприятие. Каждый риск оценивается с точки зрения вероятности его реализации и возможного ущерба. Рекомендуется выявить не менее 5-10 рисков.

Практическое задание 2.

Выбрать предприятие (реально действующее или модель).

Постановка задачи: На основе данных, описанных в предыдущем задании, необходимо составить карты потоков для оценки рисков, которым подвержено данное предприятие.

Каждый риск оценивается с точки зрения вероятности его реализации и возможного ущерба. Рекомендуется выявить не менее 3-5 рисков.

Практическое задание 1

На основе следующей исходной информации построить дерево решений и определить наиболее эффективную последовательность действий, основываясь на ожидаемых доходах.

Условия задачи:

Компания «АВС» рассматривает возможность расширения производства автобусов с тремя возможными вариантами развития событий:

1. Построить цех для производства 500 дополнительных автобусов ежегодно стоимостью $Ст_1$. При этом варианте возможны большой спрос (годовой доход в размере $Д_1$ в течение следующих 5 лет) с вероятностью p_1 и низкий спрос (ежегодные убытки $Д_2$) с вероятностью p_2 .

2. Построить цех для производства 300 дополнительных автобусов ежегодно стоимостью $Ст_2$. При этом варианте возможны большой спрос (годовой доход в размере $Д_3$ в течение следующих 5 лет) с вероятностью p_3 и низкий спрос (ежегодные убытки $Д_4$) с вероятностью p_4 .

3. Отложить строительство завода на один год для сбора дополнительной информации, которая может быть позитивной или негативной с вероятностью p_5 и p_6 соответственно. В случае позитивной информации можно построить заводы по указанным выше расценкам, а вероятности большого и низкого спроса меняются на p_7 и p_8 соответственно. Доходы на последующие четыре года остаются прежними. В случае негативной информации компания заводы строить не будет. Нарисовав дерево решений, определим наиболее эффективную последовательность действий, основываясь на ожидаемых доходах.

Исходные данные для решения задачи представлены в табл.2.

Исходные данные

Таб	Ст1	Ст2	Д1	Д2	Д3	Д4	p1	p2	p3	p4	p5	p6	p7	p8
1	490	290	190	80	90	30	0,75	0,25	0,75	0,25	0,7	0,3	0,9	0,1
2	495	295	195	85	95	35	0,75	0,25	0,75	0,25	0,7	0,3	0,9	0,1
3	505	305	205	95	100	40	0,75	0,25	0,75	0,25	0,7	0,3	0,9	0,1
4	510	310	210	100	105	45	0,75	0,25	0,75	0,25	0,7	0,3	0,9	0,1
5	515	315	215	105	110	50	0,75	0,25	0,75	0,25	0,7	0,3	0,9	0,1
6	520	320	220	110	115	55	0,75	0,25	0,75	0,25	0,7	0,3	0,9	0,1
7	525	325	225	115	120	60	0,8	0,2	0,8	0,2	0,75	0,25	0,9	0,1
8	530	330	230	120	125	65	0,8	0,2	0,8	0,2	0,75	0,25	0,9	0,1
9	535	335	235	125	130	70	0,8	0,2	0,8	0,2	0,75	0,25	0,9	0,1
10	540	340	240	130	135	75	0,8	0,2	0,8	0,2	0,75	0,25	0,9	0,1
11	545	345	245	135	140	80	0,8	0,2	0,8	0,2	0,75	0,25	0,9	0,1
12	550	350	250	140	145	85	0,8	0,2	0,8	0,2	0,75	0,25	0,9	0,1
13	555	355	255	145	150	90	0,85	0,15	0,85	0,15	0,8	0,2	0,9	0,1

14	560	360	260	150	155	95	0,85	0,15	0,85	0,15	0,8	0,2	0,9	0,1
15	565	365	265	155	160	100	0,85	0,15	0,85	0,15	0,8	0,2	0,9	0,1
16	570	370	270	160	165	105	0,85	0,15	0,85	0,15	0,8	0,2	0,9	0,1
17	575	375	275	165	170	110	0,85	0,15	0,85	0,15	0,8	0,2	0,9	0,1
18	580	380	280	170	175	115	0,85	0,15	0,85	0,15	0,8	0,2	0,9	0,1
19	585	385	285	175	180	120	0,85	0,15	0,85	0,15	0,75	0,25	0,95	0,05
20	590	390	290	180	185	125	0,85	0,15	0,85	0,15	0,75	0,25	0,95	0,05
21	595	395	295	185	190	130	0,85	0,15	0,85	0,15	0,75	0,25	0,95	0,05
22	600	400	300	190	195	135	0,85	0,15	0,85	0,15	0,75	0,25	0,95	0,05
23	605	405	305	195	200	140	0,85	0,15	0,85	0,15	0,75	0,25	0,95	0,05
24	610	410	310	200	205	145	0,85	0,15	0,85	0,15	0,75	0,25	0,95	0,05
25	615	415	315	205	210	150	0,85	0,15	0,85	0,15	0,75	0,25	0,95	0,05

Практическое задание 2

Компания “Ketta” реализует трёхлетний инвестиционный проект, инвестиционные затраты в размере 10 млн USD по которому осуществляются в течение первого года реализации проекта. Переменные издержки во второй и третий годы реализации проекта составляют – *Пер31* млн USD и *Пер32* млн USD соответственно. Постоянные издержки во второй и третий годы реализации проекта составляют - *Пост3* млн USD. Ожидаемые доходы от продаж во второй и третий год – *Д1* млн USD и *Д2* млн USD соответственно.

Ставка дисконта на период реализации проекта равна r %. Провести анализ чувствительности инвестиционного проекта к изменению следующих показателей на +/-20%: объем инвестиций, переменные издержки, постоянные издержки и доход от продаж. Исходные данные представлены в табл.4. Исходные данные записать в следующую табл.3.

В качестве результирующего показателя выбрать чистый дисконтированный доход NPV. Для расчета NPV использовать следующую формулу:

$$NPV = \sum_{i=1}^N \frac{NCF_i}{(1+r)^i} - Inv$$

где NCF_i - чистый денежный поток для i -го периода; Inv - начальные инвестиции; r - ставка дисконтирования (стоимость капитала, привлеченного для инвестиционного проекта)

Таблица 3 -Таблица для исходных данных

Показатели	2020 г.	2021 г.	2022 г.	Диапазон изменений
Объем инвестиций, млн USD				
Переменный издержки, млн USD				
Постоянные издержки, млн USD				
Доход от продаж, млн USD				
Чистая прибыль, млн USD				
Ставка дисконта, %				
Суммарный чистый денежный поток, млн. USD				

Таблица 4 -Исходные данные

	I_0	ПерЗ ₁	ПерЗ ₂	ПостЗ	Д ₁	Д ₂	r
1	25	25	25	4	45	55	10
2	35	35	35	5	55	65	10
3	40	40	40	6	65	75	10
4	45	45	45	7	75	85	10
5	50	50	50	8	85	95	10
6	55	55	55	9	95	105	10
7	60	60	60	10	105	115	10
8	65	65	65	11	115	125	10
9	70	70	70	12	125	135	15
10	75	75	75	13	135	145	15
11	80	80	80	14	145	155	15
12	85	85	85	15	155	165	15
13	90	90	90	16	165	175	15
14	95	95	95	17	175	185	15
15	100	100	100	18	185	195	15
16	105	105	105	19	195	205	15
17	110	110	110	20	205	215	20
18	115	115	115	21	215	225	20
19	120	120	120	22	225	235	20
20	125	125	125	23	235	245	20
21	130	130	130	24	245	255	20
22	135	135	135	25	255	265	20
23	140	140	140	26	265	275	20
24	145	145	145	27	275	285	20
25	150	150	150	28	285	295	20

Практическое задание к главе 7

Проведите оценку своего факультета как структурной единицы академии управления. Определите необходимость трансформаций.

Практическое задание

Организация производит и продает широкий ассортимент химикатов для обработки воды и 75 % своей продукции продает за рубежом.

Персонал организации составляет около 400 человек, значительная доля которых –это высококвалифицированных специалистов и большое количество работников физического труда.

В последние годы был осуществлен лишь незначительный найм персонала, но не проводилось никаких мероприятий по развитию персонала или по увольнению.

Недавно руководство организации приняло решение усилить координацию своих действий и организовать обмен техническим и управленческим опытом. Поставлены цели развития связей и повышения уровня вовлеченности для поощрения творчества и более целостного подхода к организационному развитию. При этом в организации хорошо понимают, что необходима программа глобальных перемен.

Задание

1. Используя концепции системного мышления и организационного развития, объяснить персоналу характер намеченных изменений, которые будут иметь серьезные долгосрочные последствия для их завода.

2. Опишите модель СТВ для данной ситуации.

3. Изложите причины, по которым любые изменения структур, процедур и практики работы влияют на индивидуумов, и объясните, почему успешное разрешение ситуации изменения должно начинаться с рассмотрения бизнес-плана и предусматривать связанные с ним мероприятия по развитию человеческих ресурсов.

4. Приведите доводы в пользу применения в данной ситуации подхода, основанного на компетентности, и подхода к развитию навыков, а так-же изложите некоторые соображения о целесообразности других мероприятий по развитию человеческих ресурсов для успешного проведения изменения.

1. 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.

Объем 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:

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

где v – верхняя граница зоны риска; a –

нижняя граница зоны риска;

x – фактическое значение $K_{тл}$.

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

$$P(x) = \frac{1,6 - 1,2}{1,8 - 1,2} = 0,33, \text{ или } 33\% \text{ что соответствует высокому уровню риска.}$$

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

$$4. P(x) = \frac{1,6 - 1,0}{2,0 - 1,0} = 0,40, \text{ или } 40\% ,$$

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 ящиков = $210 \cdot 0,1 + 305 \cdot 0,3 + 400 \cdot 0,5 + 400 \cdot 0,1 = 352,7$ у.е. – 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
	Мягкая	Обычная	Холодная	
Зима				
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]	

Практическое задание

Организация производит и продает широкий ассортимент химикатов для обработки воды и 75 % своей продукции продает за рубежом.

Персонал организации составляет около 400 человек, значительная доля которых – это высококвалифицированных специалистов и большое количество работников физического труда.

В последние годы был осуществлен лишь незначительный найм персонала, но не проводилось никаких мероприятий по развитию персонала или по увольнению.

Недавно руководство организации приняло решение усилить координацию своих действий

и организовать обмен техническим и управленческим опытом.

Поставлены цели развития связей и повышения уровня вовлеченности для поощрения творчества и более целостного подхода к организационному развитию. При этом в организации хорошо понимают, что необходима программа глобальных перемен.

Задание

1. Используя концепции системного мышления и организационного развития, объяснить персоналу характер намеченных изменений, которые будут иметь серьезные долгосрочные последствия для их завода.

2. Опишите модель СТВ для данной ситуации.

3. Изложите причины, по которым любые изменения структур, процедур и практики работы влияют на индивидуумов, и объясните, почему успешное разрешение ситуации изменения должно начинаться с рассмотрения бизнес-плана и предусматривать связанные с ним мероприятия по развитию человеческих ресурсов.

4. Приведите доводы в пользу применения в данной ситуации подхода, основанного на компетентности, и подхода к развитию навыков, а так-же изложите некоторые соображения о целесообразности других мероприятий по развитию человеческих ресурсов для успешного проведения изменения.

2.4. Рекомендации по оцениванию рефератов (докладов, сообщений)

Максимальное количество баллов	Правильность (ошибочность) решения
9-10	Выставляется обучающемуся если он выразил своё мнение по сформулированной проблеме, аргументировал его, точно определив проблему содержание и составляющие. Приведены данные отечественной и зарубежной литературы, статистические сведения, информация нормативно правового характера. Обучающийся знает и владеет навыком самостоятельной исследовательской работы по теме исследования; методами и приемами анализа теоретических и/или практических аспектов изучаемой области. Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет; графически работа оформлена правильно.
7-8	Выставляется обучающемуся если работа характеризуется смысловой цельностью, связностью и последовательностью изложения; допущено не более 1 ошибки при объяснении смысла или содержания проблемы. Для аргументации приводятся данные отечественных и зарубежных авторов. Продемонстрированы исследовательские умения и навыки. Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет. Допущены отдельные ошибки в оформлении работы.
5-6	Выставляется обучающемуся если в работе студент проводит достаточно самостоятельный анализ основных этапов и смысловых составляющих проблемы; понимает базовые основы и теоретическое обоснование выбранной темы. Привлечены основные источники по рассматриваемой теме. Допущено не более 2 ошибок в содержании проблемы, оформлении работы.
2-4	Выставляется обучающемуся если работа представляет собой пересказанный или полностью заимствованный исходный текст без каких бы то ни было комментариев, анализа. Не раскрыта структура и теоретическая составляющая темы. Допущено три или более трех ошибок в содержании раскрываемой проблемы, в оформлении работы.

ТЕМЫ ЭССЕ (ДОКЛАДОВ, СООБЩЕНИЙ) ДЛЯ ПРОВЕРКИ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИИ

Перечень тем рефератов по дисциплине (разделы 1и2)

1. Эволюция взглядов на категории «риск».
2. Выбор инвестиционного портфеля в условиях неопределенности и риска.
3. Предпосылки и факторы, предшествующие наступлению рискованных ситуаций.

4. Сущность и содержание риск-менеджмента.
5. Анализ и оценка уровня риска.
6. Методы уклонения от риска и его компенсации.
7. Методы управления финансовым риском.
8. Классификация рисков.
9. Роль Банка России в управлении банковскими рисками.
10. Способы снижения процентного и кредитного риска.
11. Понятие и классификация рисков в страховом бизнесе.
12. Концепция рисковой стоимости (Value at risk – VAR).
13. Организация управления риском на производственном предприятии.
14. Метод статистических испытаний (Monte-Carlo simulation).
15. Хеджирование рисков.
16. Управление кредитным риском в деятельности банков.
17. Статистические методы оценки риска.
18. Критерий ожидаемой полезности.
19. Риски в международной банковской деятельности.
20. Этапы управления риском.
21. Аутсорсинг управления риском.
22. Методы финансирования рисков.
23. Пороговые значения риска.
24. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.
25. Идентификация и анализ рисков.
26. Меры по предотвращению неплатежеспособности и несостоятельности российских предприятий.
27. Реструктуризация предприятия: подходы и решения.
28. Правовое регулирование отношений в сфере несостоятельности (банкротства).
29. Анализ результатов развития предприятия в условиях быстро меняющейся внешней среды.
30. Пути реструктуризации предприятия с учетом зарубежного опыта.
31. Взгляды экономистов на теорию циклов и кризисов.
32. Методы антирискового регулирования экономики.
33. Причины, факторы и симптомы кризисного развития экономики.
34. Диагностика банкротства предприятий.
35. Зарубежная практика риск-менеджмента.
36. Основные стратегии вывода предприятия из кризиса.
37. Классификация антикризисных стратегий.
38. Меры по восстановлению платежности должника.
39. Выбор оптимального объема производства в условиях неопределенности спроса.
40. Институциональные особенности принятия решений в переходной экономике.
41. Стратегия и тактика риск-менеджмента

Перечень тем рефератов по дисциплине (раздел 3)

1. Значение дисциплины «Управление изменениями»
2. Основные факторы, влияющие на развитие организации.
3. Психологические особенности поведения человека в условиях изменений.
4. Особенности лидерского поведения в условиях изменений.
5. «Измерения» управленческой деятельности.
6. Модели организационных изменений в деятельности организаций.
7. Планирование организационных изменений.
8. Виды сопротивления изменениям и методы их преодоления.
9. Технологии организационных изменений.
10. Модели организационного развития.
11. Порядок разработки проекта реинжиниринга бизнес-процессов.

12. Сравнение функциональной структуры управления и процессного управления.
13. Влияние организационной культуры на формирование организационной структуры.
14. Использование современных информационных технологий в управлении организацией.
15. Обучающаяся организация как метод изменения организационной культуры.
16. Организация проведения реинжиниринга бизнес-процессов.
17. Модели организационного развития.

2.5. Рекомендации по оцениванию научной составляющей

Научная статья должна быть выполнена по заданной теме, четко оформлен библиографический список, поставлены цели, задачи исследования, определен объект и предмет исследования, определены методы исследования, позволяющие достигнуть поставленных целей исследования, проведен анализ исследования, сделаны выводы. Оформление соответствует требованиям ГОСТ.

Согласно РПУД максимальное количество баллов – до 10, может быть увеличено до 15 баллов за очное участие в конференции.

Максимальное количество баллов (государственная оценка)	Критерии
9-10	Выставляется обучающемуся, если ответ показывает глубокое и систематическое знание всего программного материала и структуры конкретного вопроса, а также основного содержания и новаций лекционного курса по сравнению с учебной литературой. Обучающийся демонстрирует отчетливое и свободное владение концептуально-понятийным аппаратом, научным языком и терминологией соответствующей научной области. Знание основной литературы и знакомство с дополнительно рекомендованной литературой. Логически корректное и убедительное изложение ответа
7-8	Выставляется обучающемуся, если его ответ демонстрирует знание узловых проблем программы и основного содержания лекционного курса; умение пользоваться концептуально понятийным аппаратом в процессе анализа основных проблем в рамках данной темы; знание важнейших работ из списка рекомендованной литературы. В целом логически корректное, но не всегда точное и аргументированное изложение ответа
5-6	Выставляется обучающемуся, если его ответ демонстрирует фрагментарные, поверхностные знания важнейших разделов программы и содержания лекционного курса; затруднения с использованием научно-понятийного аппарата и терминологии учебной дисциплины; неполное знакомство с рекомендованной литературой; частичные затруднения с выполнением предусмотренных программой заданий; стремление логически определенно и последовательно изложить ответ
0-4	Выставляется обучающемуся, если его ответ демонстрирует незнание, либо отрывочное представление о данной проблеме в рамках учебно-программного материала; неумение использовать понятийный аппарат; отсутствие логической связи в ответе

КОМПЛЕКТ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ (ЭКЗАМЕН)

№ п/п	Содержание оценочного средства*	Индекс оцениваемой компетенции или ее элементов
1-25	Тестовые и практические задания	ПК-7.4

ВОПРОСЫ К ЭКЗАМЕНУ ПО РАЗДЕЛАМ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Раздел 1

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.
 12. Чистые, спекулятивные, фундаментальные риски.
 13. Политические риски, их виды.
 14. Природно-естественные риски.
 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.
- #### Раздел 2
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 риска.

43. Точка и параметры риска.

44. Консервативный и прогрессивный подход к определению рисков.

45. Операционные и финансовые риски.

46. Профиль рисков, фиксация и документирование.

Раздел 3

47. Цели и задачи управленческой деятельности в области управления изменениями.

48. Ключевые положения об изменениях для организации.

49. Характеристика основных изменений организации.

50. Классификация изменений.

51. Модель процесса успешного управления организационными изменениями

52. Особенности процесса принятия решений в условиях реализации изменений в организации.

53. Общий метод получения поддержки изменений и его основные аспекты.

54. Необходимость формирования личностного состава участников процесса изменений.

55. Факторы, от которых зависит подход к осуществлению изменений.

56. Сущность стратегии изменений.

57. Цель разработки и реализации стратегии изменений.

58. Естественные законы изменений.

59. Основные виды стратегий изменений.

60. Основные принципы управления процессом изменений и их характеристика.

61. Необходимость создания специальных структур для проведения изменений.

62. Основные формы систем для проведения изменений в организации: их сущность и условия, в которых необходимо их применять.

63. Особенности процесса планирования изменений в организации.

64. Особенности мониторинга и контроля процесса изменений.

65. Основные методики мониторинга и контроля процесса изменений.

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

Направление подготовки 38.04.04 Государственное и муниципальное управление
Магистерская программа Управление проектами
Кафедра инновационного менеджмента и управления проектами
Учебная дисциплина Управление рисками и изменениями
Курс 2 / 1 **Форма обучения** очная

Экзаменационный билет 1

Уровень 1

Выбрать правильный вариант ответа

- 1) Риск – это:
 - а) неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток;
 - б) все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка;
 - в) вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий;
 - г) вероятность провала программы продаж;
- 2) Управление риском – это:
 - а) отказ от рискованного проекта;
 - б) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска;
 - в) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него;
 - г) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска.
- 3) Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя:
 - а) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска;
 - б) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска;
 - в) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности;
 - г) умение ликвидировать такие последствия.
- 4) Содержательная сторона риск-менеджмента включает в себя:
 - а) планирование деятельности по реализации рискованного проекта;
 - б) сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска;
 - в) выбор мер по минимизации или устранению последствий риска;
 - г) организация службы управления рисками на предприятии.
- 5) Что из перечисленного не является элементом системы риск-менеджмента?
 - а) разработка планов, позволяющих действовать оптимальным образом в ситуации риска;

- б) разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий;
- в) учет психологического восприятия рискованных проектов;
- г) все перечисленное является элементами системы риск-менеджмента.
- 6) Какие категории задач риск-менеджмента можно выделить?
- а) применение риск-менеджмента;
- б) применение методов риск-менеджмента;
- в) управление рисками по их типам;
- г) точность оценок рисков; д) точность прогнозов рисков.
- 7) Главной функцией риск-менеджмента является:
- а) создание чуткой системы управления рисками;
- б) оценка риска по каждому проекту в компании;
- в) оценка риска для компании в целом;
- г) предотвращение банкротства компании в результате наступления случайных событий.
- 8) Какие подходы выделяют при расчете VAR?
- а) эмпирический;
- б) логический;
- в) оценочный;
- г) параметрический.
- 9) Что из перечисленного не является элементом расчета VAR для одного актива?
- а) текущая стоимость актива;
- б) чувствительность стоимости к неблагоприятному изменению фактора риска;
- в) изменение стоимости в перспективе;
- г) возможное изменение фактора риска при данном доверительном уровне;
- 10) Волатильность – это:
- а) изменчивость рыночного спроса;
- б) постоянство рыночного спроса;
- в) изменчивость курсовых разниц и процентных ставок;
- г) постоянство курсовых разниц и процентных ставок.
- 11) Суть риск-менеджмента состоит в:
- а) устранении риска;
- б) управлении риском;
- в) снижении риска;
- г) выборе риска.
- 12) Каковы функции объекта управления в риск-менеджменте?
- а) организация разрешения риска;
- б) организация работы по снижению величины риска;
- в) организация процесса страхования рисков;
- е) все перечисленное является функциями объекта управления;
- 13) Что из перечисленного не является функциями субъекта управления в риск-менеджменте?
- а) прогнозирование;
- б) организация;
- в) распределение;
- г) контроль.
- 14) Что из перечисленного является правилами риск-менеджмента?
- а) нельзя рисковать многим ради малого;
- б) нельзя думать, что существует только одно решение, возможно, есть и другие;
- в) при существовании нескольких вариантов, следует идти по пути минимально риска;
- г) положительное решение принимается лишь при отсутствии сомнения.
- 15) 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.

Уровень 2

Выбрать правильный вариант ответа

1. Чему равен коэффициент маржинального дохода на единицу продукции, если цена реализации составила 25 долл., переменные затраты на единицу - 18 долл, общие постоянные затраты - 1200 долл., объем реализации – 210 ед.?
А) 0,72; б) 0,28; в) 0,86.
2. При факторе риска β , равном 1.6, ставке безрискового вложения капитала – 9% и средней по фондовому рынку – 13% стоимость собственного капитала компании оценивается на уровне:
А) 15,4%; б) 22,7%; в) 18,4%; г) 14,4%.

Уровень 3

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