

Документ подписан простой электронной подписью.  
Информация о владельце:  
ФИО: Костина Лариса Николаевна  
Должность: проректор  
Дата подписания: 10.12.2024 14:07:12  
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**

**Менеджмента**

**Кафедра**

**Менеджмента непроизводственной сферы**

**"УТВЕРЖДАЮ"**

Проректор

\_\_\_\_\_ Л.Н. Костина

28.04.2022 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

**Б1.В.11**

**"Риск-менеджмент"**

**Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент**  
**Магистерская программа "Менеджмент организаций"**

Квалификация	<b><i>МАГИСТР</i></b>
Форма обучения	<b><i>заочная</i></b>
Общая трудоемкость	<b><i>4 ЗЕТ</i></b>
Год начала подготовки по учебному плану	<b><i>2022</i></b>

Донецк  
2022

Составитель(и):

канд. экон. наук, доцент

\_\_\_\_\_ Е.В. Тарасова

Рецензент(ы):

канд. экон. наук, доцент

\_\_\_\_\_ О.Э. Кириенко

Рабочая программа дисциплины (модуля) "Риск-менеджмент" разработана в соответствии с:

Государственным образовательным стандартом высшего профессионального образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.02 Менеджмент (утвержден приказом Министерства образования и науки Донецкой Народной Республики от 28.06.2021 г. № 87-НП);

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.02 Менеджмент (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 952)

Рабочая программа дисциплины (модуля) составлена на основании учебного плана Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент

Магистерская программа "Менеджмент организаций", утвержденного Ученым советом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС" от 28.04.2022 протокол № 10/2.

Срок действия программы: 20222025

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Менеджмента непроизводственной сферы

Протокол от 29.08.2022 № 1

Заведующий кафедрой:

канд.гос.упр., доцент Ободец Я.В.

\_\_\_\_\_ (подпись)

---

---

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

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2023 - 2024 учебном году на заседании кафедры Менеджмента непроизводственной сферы

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2023 г. №\_\_

Зав. кафедрой канд.гос.впр., доцент Ободец Я.В.

\_\_\_\_\_  
(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 Менеджмента непроизводственной сферы

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2024 г. №\_\_

Зав. кафедрой канд.гос.упр., доцент Ободец Я.В.

\_\_\_\_\_  
(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 Менеджмента непроизводственной сферы

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2025 г. №\_\_

Зав. кафедрой канд.гос.упр., доцент Ободец Я.В.

\_\_\_\_\_  
(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 Менеджмента непроизводственной сферы

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2026 г. №\_\_

Зав. кафедрой канд.гос.упр., доцент Ободец Я.В.

\_\_\_\_\_  
(подпись)

## РАЗДЕЛ 1. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ

<b>1.1. ЦЕЛИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
Цель освоения дисциплины – обеспечение фундаментальной и практической профессиональной подготовки обучающихся в области теории и практики управления рисками, а также освоения методами оценки результативности системы управления рисками.	
<b>1.2. УЧЕБНЫЕ ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
рассмотрение роли экономических законов и научных подходов в повышении качества и эффективности управления рисками в условиях неопределенности; изучение методологии управления рисками; изучение технологий процессов определения рискообразующих событий и идентификации рисков; формирование навыков практического использования современных методов мониторинга управления рисками организации и инструментами риск-менеджмента.	
<b>1.3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОСНОВНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ</b>	
Цикл (раздел) ОПОП ВО:	Б1.В
<i>1.3.1. Дисциплина "Риск-менеджмент" опирается на следующие элементы ОПОП ВО:</i>	
Налоговое администрирование	
Современный стратегический анализ	
<i>1.3.2. Дисциплина "Риск-менеджмент" выступает опорой для следующих элементов:</i>	
Управление инвестициями и проектами	
Планирование и прогнозирование в управлении	
<b>1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:</b>	
<i>ПК-8: Способен обосновывать подходы, используемые в бизнес-анализе</i>	
Знать:	
<b>Уровень 1</b>	основные понятия, концепции и методы теории управления рисками
<b>Уровень 2</b>	методы и технологии оценки рисков и управления ими;
<b>Уровень 3</b>	сущность стратегического риска и неопределенности в процессах принятия решений, особенности влияния факторов внешней и внутренней среды на деятельность организации
Уметь:	
<b>Уровень 1</b>	вырабатывать варианты решений поставленных задач и оценивать риски, связанные с их реализацией;
<b>Уровень 2</b>	использовать методики анализа и оценки риска деятельности организаций; определять приоритетные направления развития деятельности организации;
<b>Уровень 3</b>	оценивать возможность возникновения рисков при реализации неверного управленческого решения.
Владеть:	
<b>Уровень 1</b>	навыками исследования влияния факторов внешней и внутренней среды на деятельность организации;
<b>Уровень 2</b>	навыками моделирования рискованных ситуаций; навыками управления рисками в деятельности образовательной организации;
<b>Уровень 3</b>	навыками анализа и оценки риска в условиях неопределенности
<b>1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:</b>	
<i>ПК-6: Способен планировать и прогнозировать экономическую деятельность организации</i>	
Знать:	
<b>Уровень 1</b>	национальные и международные стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками;
<b>Уровень 2</b>	принципы построения систем управления рисками и компоненты системы управления рисками и их взаимосвязь;
<b>Уровень 3</b>	этапы разработки систем управления рисками.
Уметь:	
<b>Уровень 1</b>	определять стратегические и оперативные цели, ставить задачи системы управления рисками в организации;
<b>Уровень 2</b>	внедрять системы управления рисками на уровне организации, подразделения, анализировать изменения корпоративной нормативной базы по вопросам управления рисками;

<b>Уровень 3</b>	разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками, описывать бизнес-процессы с учетом рисков.
Владеть:	
<b>Уровень 1</b>	навыками определения целей и задач подразделения в соответствии со стратегическими целями организации (декомпозиция стратегических целей организации в задачи подразделения) на основании корпоративных нормативных документов по управлению рисками и требований вышестоящего руководства;
<b>Уровень 2</b>	навыками реализации плана построения системы управления рисками;
<b>Уровень 3</b>	навыками организации обеспечения работников подразделения по управлению рисками необходимым оборудованием, материально-техническими средствами и доступом к информационным системам организации.
<b>1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:</b>	
<i>ПК-3: Способен разрабатывать стратегию управления изменениями в организации</i>	
Знать:	
<b>Уровень 1</b>	положения законодательства, национальных и международных стандартов по управлению рисками и управлению непрерывностью бизнеса;
<b>Уровень 2</b>	стратегические и оперативные цели и задачи системы управления рисками в организации;
<b>Уровень 3</b>	локальные нормативные акты по управлению рисками в организации.
Уметь:	
<b>Уровень 1</b>	анализировать и применять методики реагирования на риски;
<b>Уровень 2</b>	анализировать отчеты риск-менеджеров
<b>Уровень 3</b>	анализировать информацию о рисках в отрасли и глобальные отчеты о рисках.
Владеть:	
<b>Уровень 1</b>	навыками согласования плана действий в чрезвычайных и кризисных ситуациях и периодическая адаптация его к изменениям;
<b>Уровень 2</b>	навыками организации внедрения плана действий в чрезвычайных и кризисных ситуациях в работу и контроль его исполнения;
<b>Уровень 3</b>	навыками утверждения результатов стресс-тестирования, риск-аудитов, предстраховой оценки и оповещения о результатах членов коллегиального органа управления организацией и коллегиального органа управления рисками, выработка совместного решения о необходимых действиях

***В результате освоения дисциплины "Риск-менеджмент" обучающийся должен:***

<b>3.1</b>	<b>Знать:</b>
	основные понятия, концепции и методы теории управления рисками;
	сущность стратегического риска и неопределенности в процессах принятия решений;
	навыками исследования влияния факторов внешней и внутренней среды на деятельность организации.
	принципы построения систем управления рисками, компоненты системы управления рисками и их взаимосвязь,
	этапы разработки систем управления рисками;
	национальные и международные стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками.
<b>3.2</b>	<b>Уметь:</b>
	вырабатывать варианты решений поставленных задач и оценивать риски, связанные с их реализацией;
	использовать методики анализа и оценки риска деятельности организаций;
	оценивать возможность возникновения рисков при реализации неверного управленческого решения.
	внедрять системы управления рисками на уровне организации, подразделения, применять термины и принципы риск-менеджмента;
	анализировать изменения корпоративной нормативной базы по вопросам управления рисками;
	разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками, описывать бизнес-процессы с учетом рисков.

<b>3.3 Владеть:</b>	
	навыками исследования влияния факторов внешней и внутренней среды на деятельность организации;
	навыками моделирования рискованных ситуаций;
	оценивать возможность возникновения рисков при реализации неверного управленческого решения;
	навыками определения целей и задач подразделения в соответствии со стратегическими целями организации (декомпозиция стратегических целей организации в задачи подразделения) на основании корпоративных нормативных документов по управлению рисками и требований вышестоящего руководства;
	навыками реализации плана построения системы управления рисками;
	навыками организации обеспечения работников подразделения по управлению рисками необходимым оборудованием, материально-техническими средствами и доступом к информационным системам организации.
<b>1.5. ФОРМЫ КОНТРОЛЯ</b>	
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.	
<b>Промежуточная аттестация</b>	
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 "Риск-менеджмент" видом промежуточной аттестации является Экзамен	

## РАЗДЕЛ 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

<b>2.1. ТРУДОЕМКОСТЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ</b>						
Общая трудоёмкость дисциплины "Риск-менеджмент" составляет 4 зачётные единицы, 144 часов. Количество часов, выделяемых на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающегося, определяется учебным планом.						
<b>2.2. СОДЕРЖАНИЕ РАЗДЕЛОВ ДИСЦИПЛИНЫ</b>						
Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Примечание
<b>Раздел 1. Теоретико-методологические основы управления рисками</b>						
Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками /Лек/	3	2	ПК-3 ПК-6	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Э1 Э2	0	
Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками /Сем зан/	3	2	ПК-3 ПК-6	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2	0	
Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками /Ср/	3	15	ПК-3 ПК-6	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.3 Э1 Э2	0	
Тема 1.2. Методология управления	3	0	ПК-3 ПК-	Л1.1	0	

рисками /Лек/			6 ПК-8	Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1 Э2		
Тема 1.2. Методология управления рисками /Сем зан/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2	0	
Тема 1.2. Методология управления рисками /Ср/	3	15	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.3 Э1 Э2	0	
Тема 1.3. Процессный подход к управлению рисками /Лек/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1 Э2	0	
Тема 1.3. Процессный подход к управлению рисками /Сем зан/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2	0	
Тема 1.3. Процессный подход к управлению рисками /Ср/	3	15	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.3 Э1 Э2	0	
<b>Раздел 2. Рискообразующие события и идентификация рисков</b>						
Тема 2.1. Определение рискообразующих событий /Лек/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1 Э2	0	
Тема 2.1. Определение рискообразующих событий /Сем зан/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2	0	
Тема 2.1. Определение рискообразующих событий /Ср/	3	15	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.3 Э1 Э2	0	
Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков /Лек/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1 Э2	0	
Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков /Сем зан/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2	0	

Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков /Ср/	3	15	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.3 Э1 Э2	0	
<b>Раздел 3. Мониторинг и конкретные методы управления рисками</b>						
Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски /Лек/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1 Э2	0	
Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски /Сем зан/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2	0	
Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски /Ср/	3	12	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.3 Э1 Э2	0	
Тема 3.2. Мониторинг управления рисками /Лек/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.2. Мониторинг управления рисками /Сем зан/	3	0	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.2. Мониторинг управления рисками /Ср/	3	16	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками /Лек/	3	2	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками /Сем зан/	3	2	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками /Ср/	3	20	ПК-3 ПК-6 ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
/Конс/	3	4			0	



### РАЗДЕЛ 3. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

В процессе освоения дисциплины "Риск-менеджмент" используются:

- образовательные технологии: лекции (Л), семинарские занятия (СЗ), самостоятельная работа студентов (СРС) по выполнению различных видов заданий;
- интерактивные образовательные технологии: проблемная лекция (ПЛ). Лекционный материал представлен в виде слайд-презентации в формате «PowerPoint». Для наглядности используются материалы различных научных и технических экспериментов, справочных материалов, научных статей т.д. В ходе лекции предусмотрена обратная связь со студентами, активизирующие вопросы, просмотр и обсуждение видеofilмов. При проведении лекций используется проблемно-ориентированный междисциплинарный подход, предполагающий творческие вопросы и создание дискуссионных ситуаций.

При изложении теоретического материала используются такие методы, как: монологический, показательный, диалогический, эвристический, исследовательский, проблемное изложение, а также следующие принципы дидактики высшей школы, такие как: последовательность и систематичность обучения, доступность обучения, принцип научности, принципы взаимосвязи теории и практики, наглядности и др. В конце каждой лекции предусмотрено время для ответов на проблемные вопросы.

Самостоятельная работа предназначена для внеаудиторной работы студентов, связанной с конспектированием источников, учебного материала, изучением дополнительной литературы по дисциплине, подготовкой к текущему и семестровому контролю, а также выполнением индивидуального задания в форме реферата, эссе, презентации, эмпирического исследования.

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

#### 4.1. Рекомендуемая литература

1. Основная литература			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Т. В. Денисова	Управление финансовыми рисками : учебное пособие (192 с.)	Ульяновск : УлГТУ, 2021
Л1.2	Тарасова, Е. В.	Риск - менеджмент: учебно-методическое пособие для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (магистерские программы: «Менеджмент организаций», «Стратегическое управление») очной / заочной форм обучения (170 с.)	Донецк : ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2022
2. Дополнительная литература			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Афендикова Е. Ю.	Корпоративный риск-менеджмент: учебно-методическое пособие для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» (магистерская программа «Финансы и кредит») очной / заочной форм обучения (159 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2021
Л2.2	И. П. Хоминич [и др.]	Управление финансовыми рисками. Практикум: учебное пособие для вузов (129 с.)	Москва : Издательство Юрайт, 2021
Л2.3	Таскаева, Н. Н., Прохорова, Ю. С.	Антикризисное управление и риск-менеджмент : учебно-методическое пособие (47 с.)	Москва : Издательство МИСИ – МГСУ, 2020
3. Методические разработки			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Е. В. Тарасова	Риск- менеджмент: конспект лекций для обучающихся второго курса образовательной	Донецк : ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2022

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
		программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (магистерская программа: "Менеджмент организаций") очной, заочной форм обучения (149 с.)	
ЛЗ.2	Е. В. Тарасова	Риск- менеджмент: методические рекомендации для проведения семинарских занятий для обучающихся второго курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (магистерская программа: «Менеджмент организаций») очной, заочной форм обучения (48 с.)	Донецк : ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2022
ЛЗ.3	Е. В. Тарасова	Риск- менеджмент: методические рекомендации по организации самостоятельной работы для обучающихся второго курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.02 Менеджмент (магистерская программа: «Менеджмент организаций») очной, заочной форм обучения (32 с.)	Донецк : ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2022

#### 4.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

Э1	Журнал "Риск-менеджмент"	<a href="https://risk-practice.ru/">https://risk-practice.ru/</a>
Э2	Научный рецензируемый экономический журнал "Стратегические решения и риск-менеджмент"	<a href="https://www.jsdrm.ru/jour">https://www.jsdrm.ru/jour</a>
Э3	Журнал "Управление финансовыми рисками"	<a href="https://www.grebennikoff.ru/product/23/">https://www.grebennikoff.ru/product/23/</a>

#### 4.3. Перечень программного обеспечения

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

- компьютерная техника и системы связи используются для создания, сбора и обработки информации;
- электронные презентации;
- электронная почта, форумы, видеоконференцсвязь для взаимодействия с обучающимися;
- дистанционные занятия с использованием виртуальной обучающей среды Moodle;
- Skype используется для проведения дистанционного обучения и консультаций;
- электронные библиотечные ресурсы ДОНАУИГС.

Программное обеспечение: MS Word, MS Excel, MS Power Point, виртуальная обучающая среда Moodle.

#### 4.4. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

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 Лань), а также возможностью индивидуального неограниченного доступа обучающихся в ЭБС и ЭИОС посредством Wi-Fi с персональных мобильных устройств.

#### 4.5. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Дисциплина «Риск-менеджмент» обеспечена:

1. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа: лекционная аудитория № 316, учебный корпус 3
  - комплект мультимедийного оборудования: ноутбук, мультимедийный проектор, экран;
  - специализированная мебель: доска аудиторная, столы аудиторные, стулья.
2. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, групповых индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации: № 316 учебный корпус 3
  - комплект мультимедийного оборудования: ноутбук, мультимедийный проектор, экран;
  - специализированная мебель: доска аудиторная, столы аудиторные, стулья;
3. Помещения для самостоятельной работы с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду организации: читальный зал, учебный корпус 1. Адрес: г. Донецк, ул. Челюскинцев, 163А (ГОУ ВПО "ДОНАУИГС").

### РАЗДЕЛ 5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

#### 5.1. Контрольные вопросы и задания

Перечень вопросов для промежуточной аттестации (экзамен)

1. Перечислите основные условия возникновения рисков в деятельности организации.
2. Что понимается под риском в бизнесе?
3. Каким образом инновационная функция риска способствует дальнейшему развитию организации?
4. Выделите характеристики объективного и субъективного понимания риска.
5. Перечислите внешние факторы источников возникновения рисков.
6. Что называют ценой риска?
7. Как можно определить объективные факторы влияния на экономическую деятельность?
8. Назовите основные структурные характеристики риска.
9. Перечислите задачи риск-менеджмента.
10. Перечислите основные аксиомы управления рисками. В чем смысл существования этих аксиом?
11. Почему в организации всегда существует объективная вероятность неисполнения управленческих решений? Как с этим бороться?
12. Почему общие законы управления распространяются на риск-менеджмент?
13. Почему окончательное решение по поводу принятия риска выносит собственник на средства труда?
14. Сформулируйте закон единства систем управления для риск-менеджмента.
15. В каком соотношении с общим менеджментом находится система риск-менеджмента?
16. Как звучит закон зависимости доходов и риска?
17. Почему в рисковом управлении наиболее оптимален системный подход?
18. Какие возможности для риск-менеджмента дает прогнозирование?
19. Как сочетаются принципы страхования и резервирования? Выделите их общие черты.
20. Как современный менеджмент понимает природу риска?
21. Какие две основные задачи стоят перед системой управления рисками?
22. Чем динамическая концепция риск-менеджмента отличается от статической?
23. Чему призваны служить основные методы риск-менеджмента? Перечислите их.
24. В чем заключается сущность юридических методов управления рисками?
25. По каким основаниям гражданско – правовые методы управления рисками отличаются от административно – правовых?
26. Перечислите административные методы риск-менеджмента.
27. Назовите плюсы и минусы методов страхования и резервирования. В каких случаях какой из них более приемлем?
28. Какое место в системе управления рисками занимают методы материального стимулирования? В чем их суть?
29. Роль корпоративной культуры в менеджменте очевидна. А как влияет корпоративная культура на готовность к риску в организации?
30. Какие вопросы рассматривает стратегический менеджмент управления рисками?
31. В чем выражается системный подход к управлению рисками?
32. Что отражает принцип результативности управления рисками? В чем это проявляется?
33. Каким образом внешние и внутренние ограничения влияют на риск-менеджмент?
34. Перечислите основные задачи риск-менеджмента.
35. Чем отличается деловая стратегия риск-менеджмента от функциональной?
36. Объясните различия в подходах к конкурентной стратегии организации.
37. Как отличаются стратегические изменения организации в зависимости от готовности ее к риску?
38. Перечислите вспомогательные цели риск-менеджмента.
39. Какие существуют политика управления рисками в организации?
40. Назовите виды ресурсов, используемые в тактическом управлении рисками.
41. В чем состоит сущность процессного подхода к управлению рисками?
42. Дайте определение технологии управления.
43. На какие группы подразделяются функции управления рисками в зависимости от их продолжительности во времени?
44. Что такое системный анализ в управлении рисками?
45. В чем состоит сущность планирования рисков?
46. Назовите основные виды методов мотивации и их вероятные последствия в системе риск-менеджмента.
47. Что является основными составляющими контроллинга?
48. Как принципы контроля регулируют контролирующую деятельность в области риск-менеджмента?
49. Что является основными инструментами административного контроля?
50. Каков механизм влияния косвенных факторов на эффективность управления рисками?
51. Что понимается под идентификацией и анализом рисков?
52. В чем заключается специфика этапа идентификации рисков?
53. Перечислите ряд общих процедур по минимизации последствий риска.

54. Для чего предназначен этап выбора методов управления рисками?
55. В какой области решения по принятию рисков являются первоочередными?
56. Дайте определение программы определения рисками.
57. Что предполагает этап исполнения выбранного метода управления риском?

## 5.2. Темы письменных работ

### ПЕРЕЧЕНЬ ТЕМ ДОКЛАДОВ, СООБЩЕНИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

#### РАЗДЕЛ 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

##### Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками

1. Становление риск-менеджмента.
2. Классификация рисков.
3. Риск-менеджмент как отрасль научного управления.
4. Матрица риска.

##### Тема 1. 2. Методология управления рисками

1. Классификация методов управления, обусловленная их содержанием.
2. Сущность уголовно-правовых, административно-правовых, гражданско-правовых методов.
3. Метод компенсации, спекулирования, стимулирования, сдерживания.
4. Охарактеризовать организационные, распорядительные и дисциплинарные методы.
5. Три основные направления в рамках социального управления.

##### Тема 1. 3. Процессный подход к управлению риском

1. 1. Метод постепенного приближения.
2. Дерево целей.
3. Построение рациональной системы организации.
4. Формирование оптимальной структуры организации.
5. Обеспечение организации всеми необходимыми ресурсами (финансовыми, человеческими, материальными, энергетическими и др.).

#### РАЗДЕЛ 2. РИСКООБРАЗУЮЩИЕ СОБЫТИЯ И ИДЕНТИФИКАЦИЯ РИСКОВ

##### Тема 2.1. Определение рискообразующих событий

1. Понятие рискообразующих факторов.
2. Основные принципы классификации рискообразующих факторов.
3. Рискообразующие факторы и комплексный подход к исследованию рисков.
4. Интегральные рискообразующие факторы.
5. Методы анализа рисков.

##### Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков

1. Понятие рискового капитала.
2. Пороговое значение риска.

#### РАЗДЕЛ 3. МОНИТОРИНГ И КОНКРЕТНЫЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

##### Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски

1. Уклонение и сокращение риска.
2. Перераспределение риска.

##### Тема 3.2. Мониторинг управления рисками организации

1. Текущий, оперативный и стратегический мониторинг.
2. Виды информации. Оперативная информация как средство мониторинга рисков.

##### Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками

1. Методы трансформации рисков.
2. Метод отказа от риска.
3. Методы финансирования рисков.

Темы рефератов по разделам

#### РАЗДЕЛ 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

##### Тема 1.1. Теоретические основы управления рисками

##### Тема 1. 2. Методология управления рисками

##### Тема 1. 3. Процессный подход к управлению риском

1. Западный опыт в области управления риском.
2. Механизм формирования принципов риск-менеджмента
3. Основа аксиоматики риск-менеджмента.
4. Подходы к классификации законов управления.
5. Формирование реальной власти и лидерства в организации.

6. Рационализация формальной и неформальной структуры трудового коллектива.
7. Создание и развитие единой корпоративной культуры.
8. Особенности применения психологических методов управления рисками.
9. Производственные методы риск-менеджмента.
10. Использование научно-прикладных методов управления в системе риск-менеджмента.
11. Пирамида потребностей Маслоу.
12. Система регулирования деятельности организации.
13. Конструктивные и деструктивные цели.
14. Контроллинг, как новое направление контрольной деятельности.
15. Управленческий учет в системе управления.

## РАЗДЕЛ 2. РИСКООБРАЗУЮЩИЕ СОБЫТИЯ И ИДЕНТИФИКАЦИЯ РИСКОВ

Тема 2.1. Определение рискообразующих событий

Тема 2.2. Идентификация и анализ рисков

1. Методы снижения рисков.
2. Сокращение возможных потерь.
3. Методы передачи риска.
4. Схемы переноса риска.
5. Визуализация рисков.
6. Основные принципы оценки рисков.
7. Этапы управления рисками.
8. Концепция приемлемого риска.

## РАЗДЕЛ 3. МОНИТОРИНГ И КОНКРЕТНЫЕ МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

Тема 3.1. Контроль и способы реагирования на риски

Тема 3.2. Мониторинг управления рисками организации

Тема 3.3. Конкретные методы управления рисками

1. Современные средства контроля и реагирования на возникающие риски.
2. Примеры применения систем контроля рисков на предприятиях.
3. Современные средства коммуникации, применяемые для мониторинга возникновения рисков.
4. Виды и этапы мониторинга рисков.
5. Дополнительные средства, применяемые для мониторинга рисков.
6. Методики расчетов финансовых рисков.
7. Понятие и применение «нестрахового» пула.
8. Кэптивные страховые компании.

## ТИПОВЫЕ ПРАКТИЧЕСКИЕ ЗАДАНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Практическое задание 1.

Торговый агент предлагает предприятиям новый продукт. Из предыдущего опыта ему известно, что в среднем 1 из 65 клиентов, которым он предлагает товар, покупает его. В течение некоторого промежутка времени он предложил продукт 20 предприятиям. Чему равна вероятность того, что он продаст им хотя бы единицу товара?

Практическое задание 2.

Инвестор планирует вложить средства в мясоперерабатывающие предприятия А и Б. Надежность первого оценивается экспертами на уровне 70 %, а второго – 85 %. Чему равна вероятность того, что: а) оба предприятия в течение года не станут банкротами? б) наступит хотя бы одно банкротство?

Практическое задание 3.

Крупный концерн мясо-молочных предприятий намеревается реализовать акции дочерних предприятий А и Б. На основании статистических расчетов вероятность того, что акция А поднимется завтра в цене, равна 0,4. Вероятность того, что обе акции А и Б поднимутся завтра в цене, равна 0,18. Предположим, что известно, что акция А поднимется в цене завтра. Чему равна вероятность того, что и акция Б завтра поднимется в цене?

### 5.3. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств дисциплины "Риск-менеджмент" разработан в соответствии с локальным нормативным актом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС".

Фонд оценочных средств дисциплины "Риск-менеджмент" в полном объеме представлен в виде приложения к данному РПД.

### 5.4. Перечень видов оценочных средств

Устный опрос, тестовые задания, практические задания, доклады, рефераты

## 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**

Предлагаемые рекомендации оказывают методическую помощь при самостоятельном изучении дисциплины. Рекомендуется такая последовательность: ознакомиться с содержанием рабочей программы учебной дисциплины; изучить и законспектировать соответствующие темы рекомендуемой литературы. Кроме того, целесообразно ознакомиться с новыми статьями специальных журналов и сборников.

Учитывая тот факт, что изучение дисциплины предусматривает кропотливую работу и содержательное обсуждение вопросов на семинарских занятиях, именно во время самостоятельной работы студент углубляет понимание проблем, активизирует самостоятельный поиск, систематизирует накопленный опыт аналитико-синтетической работы, закладывает основы качественной подготовки докладов, сообщений, рефератов, как по собственным интересам, так и по заданию преподавателя.

Методические рекомендации по работе над конспектом лекций во время и после проведения лекции

В ходе лекционных занятий обучающимся рекомендуется выполнять следующие действия. Вести конспектирование учебного материала. Обращать внимание на категории, формулировки, раскрывающие содержание тех или иных явлений и процессов, научные выводы и практические рекомендации по их применению. Задавать преподавателю уточняющие вопросы с целью уяснения теоретических положений, разрешения спорных ситуаций. Желательно оставить в рабочих конспектах поля, на которых во внеаудиторное время можно сделать пометки из рекомендованной литературы, дополняющие материал прослушанной лекции, а также подчеркивающие особую важность тех или иных теоретических положений.

Методические рекомендации к семинарским занятиям

При подготовке к семинарским занятиям обучающимся необходимо изучить основную литературу, ознакомиться с дополнительной литературой, новыми публикациями в периодических изданиях: журналах, газетах и т.д. При этом учесть рекомендации преподавателя и требования рабочей программы учебной дисциплины. В ходе подготовки к семинарским занятиям необходимо освоить основные понятия и методики расчета показателей, ответить на контрольные вопросы. В течении семинарского занятия студенту необходимо выполнить задания, выданные преподавателем.

Рекомендации по работе с литературой. Теоретический материал дисциплины становится более понятным, когда дополнительно к прослушиванию лекции и изучению конспекта, изучаются и книги. Легче освоить дисциплину, придерживаясь одного учебника и конспекта. Рекомендуется, кроме «заучивания» материала, добиться состояния понимания изучаемой темы дисциплины. С этой целью рекомендуется после изучения очередного параграфа выполнить несколько простых упражнений на данную тему. Кроме того, очень полезно мысленно задать себе следующие вопросы (и попробовать ответить на них): о чем этот параграф, какие новые понятия введены, каков их смысл, что даст это на практике?