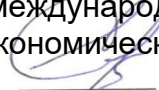


МИНОБРНАУКИ РОССИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ВОРОНЕЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
(ФГБОУ ВО «ВГУ»)

УТВЕРЖДАЮ
Заведующий кафедрой
международной экономики и
внешнеэкономической деятельности
 Ендовицкая Е.В.
20.06.2018 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.В.ДВ.17.02 Управление рисками

Код и наименование дисциплины в соответствии с учебным планом

1. Код и наименование направления подготовки/специальности:

380301 «Экономика»

2. Профиль подготовки/специализация: основная образовательная программа высшего образования «Мировая экономика»

3. Квалификация (степень) выпускника: бакалавр

4. Форма обучения: очная

5. Кафедра, отвечающая за реализацию дисциплины: кафедра международной экономики и внешнеэкономической деятельности

6. Составители программы: Бабичева Надежда Эвальдовна, доктор экономических наук, доцент

7. Рекомендована: НМС факультета международных отношений, протокол № 6 от 20.06.2018 г.

отметки о продлении вносятся вручную)

8. Учебный год: 2021/2022

Семестр(ы): 7

9. Цели и задачи учебной дисциплины:

Цель учебной дисциплины: сформировать у обучающихся общепрофессиональные и профессиональные компетенции в области управления рисками в соответствии с основной образовательной программой по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата), профиль «Мировая экономика»: способности оценки предлагаемых вариантов решений по управлению рисками, разработки и обоснования риск-стратегий с учетом критериев социально-экономической эффективности и возможных социально-экономических последствий, способности применять знания, умения и личные качества в соответствии с задачами основного вида профессиональной деятельности – аналитической, научно-исследовательской деятельности.

Задачи учебной дисциплины:

- сформировать у обучающихся теоретические знания о сущности и содержании концепции риск-менеджмента;
- выработать у обучающихся способность разрабатывать риск-стратегии;
- сформировать практические навыки и умения оценки, диагностики и прогнозирования рисков экономической деятельности хозяйствующих субъектов;
- сформировать практические навыки и умения выявлять риски экономической деятельности, осуществлять выбор методов оценки и управления ими в системе риск-менеджмента с учетом критериев социально-экономической эффективности и возможных социально-экономических последствий.

10. Место учебной дисциплины в структуре ООП: дисциплина по выбору Блока Б1, вариативная часть ООП 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата), профиль «Мировая экономика».

Перечень дисциплин, которые формируют способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий (ПК-11), полученным по окончании изучения дисциплин, предшествующих учебной дисциплине Б1.В.ДВ.17.02 Управление рисками:
Инвестиции в международном бизнесе
Международный маркетинг

Перечень дисциплин и блоков, для которых дисциплина Б1.В.ДВ.19.2 «Управление рисками», является предшествующей, а также требования к знаниям, умениям и навыкам, которые формируют компетенции по окончании изучения данной учебной дисциплины для изучения последующих :

Таможенное дело

Разработка инвестиционных проектов с помощью программы Project Expert

Международные перевозки

Производственная преддипломная практика

Государственная итоговая аттестация

11. Планируемые результаты обучения по дисциплине/модулю (знания, умения, навыки), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы (компетенциями выпускников):

Компетенция		Планируемые результаты обучения
Код	Название	

ПК-11	Способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	<p><i>знать</i>: теоретические и методические основы оценки элементов риска, моделей и механизмов управления рисками на предприятиях; разработки и выбора риск-стратегий с учетом критериев социально-эколого-экономической эффективности и прогнозирования возможных социально-экономических последствий;</p> <p><i>уметь</i>: критически оценить предлагаемые варианты построения корпоративной системы управления рисками, разработать и обосновать управленческие решения относительно выбора риск-стратегий с учетом социальной и экологической составляющей корпоративной ответственности;</p> <p><i>владеть</i> (иметь навыки): основными методами и методологией оценки и контроля за функционированием корпоративной системы риск-менеджмента, разработки и оценки эффективности реализации риск-стратегий в целях создания механизмов и моделей управления рисками с учетом социальной и экологической составляющей корпоративной ответственности</p>
-------	---	---

12. Объем дисциплины в зачетных единицах/час. — 2/72

Форма промежуточной аттестации – зачет.

13. Виды учебной работы

Вид учебной работы	Трудоемкость, час.	
	Всего	По семестрам
		7 семестр
Аудиторные занятия	36	36
в том числе: лекции	–	–
практические	36	36
лабораторные	–	–
Самостоятельная работа	36	36
Форма промежуточной аттестации (зачет – 0 час.)	–	–
Итого:	72	72

13.1. Содержание дисциплины

п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела дисциплины	Реализация раздела дисциплины с помощью онлайн-курса, ЭУМК
1. Лекции			
Не предусмотрены			
2. Практические занятия			
2.1	Теоретические основы управления рисками	2.1.1. Сущность и причины возникновения рисков; 2.1.2. Классификация и элементы корпоративных рисков;	https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=9355

		2.1.3. Концепция риск-менеджмента: сущность, содержание, принципы	
2.2	Методология риск-менеджмента	2.2.1. Системный и процессный подходы к управлению рисками; 2.2.2. Этапы риск-менеджмента; 2.2.3. Методы управления рисками: юридические, организационные, производственно-технологические, экономические, экологические, социальные и т.д.	https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=9355
2.3	Методы оценки и анализа рисков экономической деятельности хозяйствующих субъектов	2.3.1. Качественные методы идентификации и оценки рисков (мозговой штурм, метод экспертных оценок, метод аналогий, Delphi-метод, SWOT-анализ и т.п.); 2.3.2. Количественные методы идентификации и оценки вероятности возникновения рисков; 2.3.3. Диагностика и прогнозирование последствий рисков	https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=9355
2.4	Учет неопределенности и риска при оценке эффективности проектов	2.4.1. Методы учета фактора неопределенности (проверка устойчивости, корректировка параметров проекта и экономических нормативов, формализованное описание неопределенности). 2.4.2. Укрупненная оценка устойчивости проекта в целом; 2.4.3. Оценка границ безубыточности проекта; 2.4.4. Оценка устойчивости проекта путем варьирования его параметров; 2.4.5. Оценка ожидаемой эффективности проекта с учетом количественных характеристик неопределенности	https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=9355
2.5	Разработка риск-стратегии и контроль за ее реализацией	2.5.1. Организация процесса выбора риск-стратегии; 2.5.2. Стратегия уклонения; 2.5.3. Стратегия передачи (распределение, хеджирование, страхование); 2.5.4. Стратегия принятия и удержания; 2.5.5. Стратегия снижения (лимитирование,	https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=9355

		диверсификация, самострахование, локализация); 2.5.6. Оценка системы контроля за реализацией риск-стратегии	
--	--	--	--

13.2. Темы (разделы) дисциплины и виды занятий

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Виды занятий (часов)		
		Практические	Самостоятельная работа	Всего
1	Теоретические основы управления рисками	4	4	8
2	Методология риск-менеджмента	6	8	14
3	Методы оценки и анализа рисков экономической деятельности хозяйствующих субъектов	10	8	18
4	Учет неопределенности и риска при оценке эффективности проектов	10	8	18
5	Разработка риск-стратегии и контроль за ее реализацией	6	8	14
Итого:		36	36	72

14. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

14.1. Методические указания по выполнению видов работ для прохождения промежуточной аттестации

Для освоения дисциплины обучающимся необходимо работать с лекционными материалами (конспектами лекций) и практическими заданиями, размещенными на образовательном портале <https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=9355>, основной и дополнительной литературой, выполнять задания на практических занятиях и в процессе самостоятельной работы, пройти текущие аттестации.

Дополнительные методические рекомендации по выполнению практических заданий, а также замечания по результатам их выполнения могут размещаться на портале <https://edu.vsu.ru/> в виде индивидуальных комментариев и файлов обратной связи, сообщений форума и других элементов электронного курса.

Для выполнения практических заданий необходимо предварительно изучить основную литературу, приведенную в п. 15.а. В совокупность выполненных работ обучающимся включается научная дискуссия в ходе каждого практического занятия (подготовка докладов, рефератов), решение задач и ситуаций, а также самостоятельное выполнение аудиторной контрольной работы по окончании изучения дисциплины.

Для обеспечения систематической и регулярной работы по изучению дисциплины и успешного прохождения текущих и промежуточных аттестационных испытаний обучающимся рекомендуется:

- 1) выполнить все виды самостоятельных работ, предусмотренных рабочим учебным планом по учебной дисциплине (подготовка материала к научной

дискуссии, эссе, рефератов, самостоятельное решение задач и ситуаций творческих уровней, выполнение аудиторной контрольной работы).

Важную роль в системе индивидуальной самостоятельной работы играет процесс усвоения понятийного аппарата дисциплины, поскольку одной из важнейших задач подготовки к профессиональной деятельности является овладение и грамотное применение профессиональной терминологии, чему способствует регулярная работа с различными словарями, справочниками и другими источниками информации.

Особое место отводится самостоятельной проработке обучающимися отдельных разделов и тем по изучаемой дисциплине. Такой подход вырабатывает у обучающихся умения более эффективной работы с источниками информации, рационального отбора информации, ее анализа. Самостоятельное изучение вопросов каждой темы с использованием основной и дополнительной литературы способствует более глубокому усвоению теоретических основ предмета изучения. Изучение рекомендованной литературы следует начинать с учебников и учебных пособий, затем переходить к научным монографиям и статьям в периодических научных изданиях. Привлечение к работе достаточного объема литературы позволяет обучающимся получить альтернативные и вариативные взгляды на изучаемые вопросы, что позволит выработать собственную аргументированную точку зрения на исследуемые процессы и явления, более глубокое понимание материала, что будет способствовать более быстрому формированию общекультурных, общепрофессиональных и профессиональных компетенций;

2) на практических занятиях обучающийся должен уметь последовательно излагать свои мысли, уметь вести научную полемику. Для достижения этой цели необходимо:

- ознакомиться с соответствующей темой рабочей программы изучаемой дисциплины; с содержанием вопросов, которые в ней раскрываются;
- изучить теоретический материал по данной теме;
- ознакомиться с вопросами к научной полемике по каждой теме;
- изучить рекомендованную литературу по данной теме;
- подготовить краткое выступление (эссе, реферат) по теме практического занятия.

При подготовке материала к научной дискуссии можно воспользоваться следующим алгоритмом изложения темы:

- определение и характеристика основных категорий, которые раскрывают предмет исследования – управление рисками экономических субъектов;

– выявление причинно-следственных связей, определяющих характер развития, выявление общего и особенного в развитии предмета.

Весьма презентабельным вариантом выступления следует считать его подготовку в среде Power Point, что существенно повышает степень визуализации, а, следовательно, доступности, понятности материала и заинтересованности аудитории к результатам самостоятельной работы обучающегося;

- 3) самостоятельно выполнить индивидуальные задания, которые направлены на отработку умений и навыков при решении профессиональных задач в аналитической и научно-исследовательской, расчетно-экономической и организационно-управленческой деятельности. При выполнении творческих заданий необходимо привести развернутые пояснения выполнения задания и содержательно интерпретировать полученные результаты в форме информационного обзора или аналитического отчета. При необходимости обучающиеся имеют возможность задать вопросы преподавателю и разрешить возникшие трудности;
- 4) сдать все виды работ по каждой изученной теме преподавателю;
- 5) выполнить аудиторную контрольную работу по окончании изучения дисциплины, которая является формой допуска к прохождению промежуточной аттестации (зачету);
- 6) обеспечить посещение аудиторных практических занятий.

При выполнении вышеуказанных видов работ рекомендуется использование учебной литературы, дополнительных файлов с теоретическим материалом, по изучаемым темам (файлы передаются обучающимся в электронном виде). При этом следует учесть рекомендации преподавателя и требования учебной программы. В связи с тем, что активность обучающегося на практических занятиях является предметом контроля его продвижения в освоении дисциплины, то подготовка к таким занятиям требует ответственного отношения.

По окончании изучения дисциплины формой промежуточной аттестации является зачет.

Успешное завершение изучения дисциплины в значительной степени обеспечивает систематическая работа обучающегося в течение всего периода изучения дисциплины.

В начале семестра рекомендуется внимательно изучить перечень вопросов к итоговому испытанию по данной дисциплине, а также использовать в процессе обучения программу и другие методические материалы, разработанные кафедрой международной экономики и внешнеэкономической деятельности по данной

дисциплине, что позволит сформировать у обучающихся профессиональные компетенции в области решения аналитических и исследовательских задач в деятельности зарубежных организаций в соответствии с основной образовательной программой в соответствии с основной образовательной программой по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата), профиль «Мировая экономика».

14.2. Методические указания по выполнению творческих заданий, выполняемых в форме информационного обзора, аналитического отчета, рефератов и презентаций в процессе самостоятельной работы

14.2.1. Общие рекомендации к содержанию творческих заданий, выполняемых в форме информационного обзора, аналитического отчета, рефератов

Творческие задания, выполняемые в форме выполняемых в форме информационного обзора, аналитического отчета, рефератов, представляют собой документ, содержащий обобщенные результаты аналитической, научно-исследовательской деятельности по выданному заданию. Как правило, объем не должен превышать 7-10 страниц А4.

Работа должна состоять из следующих разделов:

Титульный лист.

Содержание.

Аннотация.

Основная часть работы.

Список литературы.

Приложения.

Титульный лист творческого задания оформляется по образцам, представленным на кафедре международной экономики и внешнеэкономической деятельности.

Содержание включает наименование всех разделов с указанием номеров страниц, на которых размещается начало материала раздела. При этом знак № не ставится.

Аннотация содержит краткое изложение содержания исследования, цели и задачи объекта, методы исследования, обоснование и полученные результаты. Каждый из этих параметров начинается с абзаца. В аннотации указываются используемые источники информации. Размер аннотации не должен превышать 2/3 страницы формата А4.

Изложение материала в основной части работы структурируется по разделам, на основании выданных заданий. Каждый раздел должен содержать выводы и предложения по совершенствованию объекта исследования.

Во избежание вопросов плагиата следует делать ссылки в тексте на используемые источники, приведенные в работе списком литературы. Список литературы включает в себя нормативные правовые акты, специальную научную и учебную литературу, статьи в журналах периодической печати, зарубежную литературу, интернет-источники, другие использованные материалы, и должен быть организован в соответствии с едиными требованиями библиографического описания произведений печати.

Система расположения нормативно-правовых актов в списке должна соответствовать системе расположения нормативных правовых актов федерального значения в Собрании Законодательства Российской Федерации. Прочие нормативно-правовые акты располагаются в соответствии с их иерархической принадлежностью.

1 Законы:

- Конституция РФ;
- Федеральные конституционные законы;
- Федеральные законы.

2 Подзаконные правовые акты:

- Указы Президента РФ;
- Постановления Правительства РФ;
- Акты федеральных органов исполнительной власти (министерств, федеральных ведомств и служб).

3 Локальные нормативно-правовые акты.

Специальная научная и учебная литература, как правило, оформляется в алфавитном порядке.

Примеры библиографического описания

(для списков литературы)

1. Книга под фамилией автора (описание книги начинается с фамилии автора, если авторов у книги не более трех).

1.1. Один автор: Бирюков П. Н. Международное право : учебное пособие / П. Н. Бирюков. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва : Юристъ, 2000. – 416 с.

1.2. Два автора: Винников А. З. Дорогами тысячелетий : Археологи о древней истории Воронежского края / А. З. Винников, А. Т. Синюк. – 2-е изд., испр. и доп. – Воронеж : Издательство Воронежского государственного университета, 2003. – 280 с.

1.3. Три автора: Степин В. С. Философия науки и техники : учебное пособие для вузов / В. С. Степин, В. Г. Горохов, И. А. Розов. – Москва : Гардарика, 1996. – 400 с.

2. Книга под заглавием (описание книги начинается с заглавия, если она написана четырьмя и более авторами. На заглавие описываются коллективные монографии, сборники статей и т. п. Сведения, взятые не с титульного листа, заключаются в квадратные скобки).

2.1. Психолого-педагогическая эффективность преподавателя высшей школы как фактор развития современного профессионального образования : сборник статей / редкол.: Н. И. Вьюнова (отв. ред.), Е. В. Кривотулова, Л. А. Кунаковская – Воронеж : Издательско-полиграфический центр Воронежского государственного университета, 2012. – 376 с. – (90-летию кафедры педагогики и педагогической психологии посвящается).

2.2. Культурология : учебное пособие для вузов / [под ред. А. И. Марковой]. – 3-е изд. – Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2007. – 315 с.

2.3. Если у книги четыре или более авторов, то после заглавия за косой чертой (/) в области ответственности приводится первый из них с добавлением [и др.]:

Практикум по уголовному праву. Часть общая / К. А. Панько [и др.]. – Воронеж : Издательство Воронежского государственного университета, 2001. – 128 с.

3. Статья из журнала: Кряжков В. Административные суды : какими им быть? / В. Кряжков, Ю. Старилев // Российская юстиция. – 2001. – № 1. – С. 18–20.

4. Статья из газеты: Шереметьевский Н. Банк сильнее и губернатора, и прокурора / Н.

Шереметьевский // Парламентская газета. – 2001. – 13 нояб.

Если газета имеет более 8 страниц, в описании приводится номер страницы, на которой помещена статья.

Козлов М. Очеловеченность человека / М. Козлов // Книжное обозрение. – 2001. – 4 июня. – С. 10.

5. Статья из продолжающегося издания:

Трещевский Ю. И. Регион как институциональная система / Ю. И. Трещевский, Е. М. Исаева // Вестник Воронежского государственного университета. Сер. Экономика и управление. – Воронеж, 2012. – №1. – С. 81-88.

6. Статья из сборника:

Глухова А. В. Политическая конфликтология между старыми и новыми подходами / А. В. Глухова // Конфликтология – теория и практика. – Санкт-Петербург, 2003. – С. 20–32.

7. Статья из собрания сочинений:

Асмус В. Метафизика Аристотеля / В. Асмус // Сочинения : в 4 т. / Аристотель. – Москва, 1975. – Т. 1. – С. 5–50.

8. Нормативные акты:

8.1. О государственной судебно-экспертной деятельности в Российской Федерации : федер. закон Рос. Федерации от 31 мая 2001 г. № 73–ФЗ // Ведомости Федерального Собрания Российской Федерации. – 2001. – №17. – Ст. 940. – С. 11–28.

8.2. О борьбе с международным терроризмом : постановление Гос. Думы Федер. Собр. Рос. Федерации от 20 сент. 2001 г. № 1865–III ГФ // Собрание законодательства Российской Федерации. – 2001. – № 40. – Ст. 3810. – С. 8541–8543.

8.3. Жилищный кодекс Российской Федерации от 29 дек. 2004 г. № 188–ФЗ : (с изм. и доп.) // Гарант. – URL: <http://www.garant.ru/law/12038291-000.htm> (дата обращения: 07.11.2008).

9. Библиографическое описание ресурсов из Internet:

9.1. Коротких Л. М. Религия древних иберов / Л. М. Коротких // *Commentarii de Historia* : электрон. журн. – 2002. – № 6. – URL: <http://www.main.vsu.ru/~CdH/Articles/06-02a.htm> (дата обращения: 12.12.2017).

9.2. Лэтчфорд Е. У. С Белой армией в Сибири / Е. У. Лэтчфорд // Восточный фронт армии адмирала А. В. Колчака. – URL: <http://east-front.narod.ru/memo/latchford.htm> (дата обращения: 19.01.2017).

9.3. Русское православие. – URL: <http://www.ortho-rus.ru/> (дата обращения: 08.05.2017).

Приложения содержат материалы, необходимые для разъяснения существа работы, изложенного в ее основной части: иллюстративный графический материал (более 1 страницы), таблицы, если они обширны и загромождают основную часть работы (более 2 страниц), документы организации (бухгалтерская отчетность, первичные документы, схемы). Приложения располагаются в порядке появления ссылок на них в основном тексте работы. Количество приложений в работе определяется только необходимостью их введения в работу. При оформлении приложения указывается не только его номер, но и название приложения, отражающего его суть.

14.2.2. Требования к оформлению работы

Текст работы располагается на одной стороне листа белой бумаги формата А4 (11) по ГОСТ 2.301-68 (размер 210 × 297 мм). Допускается представлять иллюстрации и таблицы на листах формата не более 420 × 594 мм. Должны соблюдаться следующие размеры полей:

- * левое - не менее 30 мм;
- * правое - не менее 10 мм;
- * верхнее - не менее 15 мм;
- * нижнее - не менее 20 мм.

Текст работы может быть набран в текстовом редакторе Microsoft Word шрифтом Times New Roman (14 пунктов) через полтора интервала. Абзацный отступ равен 125 мм.

На страницах номер проставляют, как правило, сверху по центру. На титульном листе номер не ставится, но включается в общую нумерацию работы.

Деление текста на части: Весь текст делится на разделы, главы и параграфы. Все главы, параграфы, разделы, должны начинаться с заголовка. В заголовке не допускается перенос слов. Точка в конце заголовка не ставится. Если заголовок включает несколько предложений, их разделяют точками. Заголовки разделов, подразделов, глав и параграфов обычно печатаются с выравниванием по центру. Каждый раздел и глава начинаются с нового листа (страницы). Расстояние между заголовком и текстом должно быть равно 1 двойному интервалу.\

Главы должны иметь порядковую нумерацию в пределах всей работы и обозначаться арабскими цифрами. Параграфы нумеруются арабскими цифрами в пределах главы, например: 2.1. Анализ данных (первый подраздел второго раздела). Не нумеруются введение, заключение, список литературы.

Оформление иллюстраций : Иллюстрации располагают после первой ссылки на них или в приложении.

Иллюстрации должны иметь наименование, которое вместе с поясняющими данными размещаются под ней, межстрочный интервал для подписи под рисунками должен быть одинарным. Иллюстрации обозначаются «Рис.» и нумеруются последовательно арабскими цифрами в пределах главы. Номер иллюстрации должен состоять из номера главы и порядкового номера иллюстрации, разделенных точкой. Например: Рис.1.2. В наименовании иллюстрации точка после номера рисунка ставится, а в тексте, где идет ссылка на иллюстрацию – нет, причем слово «рис.» начинается со строчной буквы, например, (рис. 1.2).

Оформление таблиц: Цифровой материал, как правило, должен оформляться в виде таблиц.

Каждая таблица должна иметь заголовок. Заголовок и слово «Таблица» начинают с прописной буквы перед таблицей. Заголовок не подчеркивают.

Заголовки граф таблиц должны начинаться с прописных букв, подзаголовки – со строчных, если они составляют одно предложение с заголовком, и с прописных, если они самостоятельные. Не допускается делить головки таблиц по диагонали. Высота строк должна быть не менее 8 мм.

Таблицу размещают после первого упоминания о ней в тексте или в приложении таким образом, чтобы ее можно было читать без поворота работы или с поворотом по часовой стрелке. Таблицу с большим количеством строк допускается переносить на другой лист. При переносе таблицы на другой лист (страницу) заголовок помещают только над ее первой частью. Таблицу с большим количеством граф допускается делить на части и помещать одну часть под другой в пределах одной страницы. Если строки или графы таблицы выходят за формат страницы, то в первом случае и в каждой части таблицы повторяется ее головка (самая первая строка таблицы), во втором случае – боковик (самая левая графа таблицы).

Если повторяющийся в графах таблицы текст состоит из одного слова, его допускается заменять кавычками; если из двух или более слов, то при первом повторении его заменяют словами «То же», и далее кавычками. Не допускается ставить кавычки вместо повторяющихся цифр, марок, знаков, математических и химических символов. Если цифровые или иные данные в какой-либо строке таблицы не приводят, то в ней ставят прочерк.

Таблицы нумеруют последовательно арабскими цифрами в пределах главы. Над заголовком таблицы помещают надпись «Таблица» с указанием номера таблицы. Номер таблицы должен состоять из номера главы и порядкового номера таблицы, разделенных точкой, например: Таблица 1.2 (вторая таблица первого раздела). Если таблица одна, она не нумеруется и слово «Таблица» не пишется. При переносе части таблицы на другой лист слово «Таблица» и номер ее указывают один раз справа над первой частью таблицы; над другими частями пишут слово «Продолжение». Если таблица не одна, то после слова «Продолжение» указывают номер таблицы, например: Продолжение табл. 1.2.

Оформление формул: Пояснение значений символов и числовых коэффициентов следует приводить непосредственно под формулой в той же последовательности, в какой они были даны в формуле. Значение каждого символа и числового коэффициента следует давать с новой строки. Первую строку объяснения начинают со слов «где» без двоеточия.

Уравнения и формулы следует выделять из текста свободными строками. Выше и ниже каждой формулы должно быть оставлено не менее одной свободной строки.

Если уравнение не умещается в одну строку, оно должно быть перенесено после знака равенства (=) или знаков плюс (+), минус (-), умножения (×) и деления (:).

Формулы в работе (если их более одной) нумеруют арабскими цифрами в пределах раздела. Номер формулы состоит из номера раздела и порядкового номера формулы в разделе, которые разделены точкой. Формула должна быть выровнена по центру, а ее номер – по правому краю. Номер указывают на уровне формулы в круглых скобках, например: (3.2) – вторая формула третьей главы.

Основные правила цитирования:

Цитаты должны применяться тактично по принципиальным вопросам и положениям. Не рекомендуется слишком обильное цитирование (употребление двух и более цитат подряд). Не допускается соединять две цитаты в одну (это равносильно подделке). Цитировать авторов необходимо только по их произведениям. Когда источник не доступен, разрешается воспользоваться цитатой этого автора, опубликованной в каком-либо другом издании. В этом случае ссылке должны предшествовать слова: «Цит. по:...». Например: Цит. по: Шимони К. Физическая электроника. - М., 1977. С. 52.

При цитировании нужно соблюдать точное соответствие цитаты источнику. Допустимы лишь следующие отклонения:

* могут быть модернизированы орфография и пунктуация по современным правилам, если это не индивидуальная орфография или пунктуация автора;

* могут быть пропущены отдельные слова, словосочетания, фразы в цитате при условии, что, во-первых, мысль автора не будет искажена пропуском, во-вторых, этот пропуск будет обозначен многоточием.

Цитаты, точно соответствующие источнику, обязательно берутся в кавычки. Кавычки не ставят в перефразированной цитате. На каждую цитату, оформленную в кавычках или без кавычек, а также любое заимствование из чужой работы (таблицу, схему, карту и т.п.) должна быть дана библиографическая ссылка. Библиографическая ссылка – это указание источника заимствования в соответствии с правилами библиографического описания.

Указание источника заимствования может осуществляться тремя способами:

* подстрочные примечания;

* указание источника непосредственно в тексте;

Например : «Основные средства – это средства труда, предназначенные для производства продукции» [5, с. 126]. Как указывал в своей работе А. Гершенкрон,

российская экономика в широком географическом и временном контексте сложна [18, с. 225].

Применение чужих идей, фактов, цитат без ссылки на источник заимствования является нарушением авторского права и расценивается как плагиат, то есть присвоение чужого авторства, выдача чужого произведения или изобретения за собственное!

Примечание: правила оформления библиографического описания документов представлены на сайте библиотеки ВГУ (www.lib.vsu.ru).

Сокращение слов и словосочетаний : При оформлении списка использованной литературы, подстрочных и внутритекстовых библиографических ссылок допускается применять сокращения слов и словосочетаний, часто встречающихся в библиографическом описании, при условии, что сокращения эти должны быть оформлены в соответствии с:

* ГОСТ Р.7.0.12– 2008. Библиографическая запись. Сокращение слов на русском языке. Общие требования и правила. – М: Информационная система ТЕХНОРМАТИВ, 2012. – 25.с.;

* ГОСТ 7.11– 2004. Библиографическая запись. Сокращение слов и словосочетаний на иностранных европейских языках. – М.: Стандартинформ, 2005. – 82 с.

Примечание: Все остальные сокращения, не предусмотренные в настоящих стандартах, допускается применять только в том случае, если в работе имеется их расшифровка, то есть после содержания перед текстом работы на отдельной странице приводится список принятых сокращений.

Терминология: В работе должны применяться научные термины в области экономики, а также другие языковые и знаковые средства, установленные в:

- * международных стандартах (рекомендациях) ИСО, МЭК;
- * терминологических приложениях к стандартам всех видов;
- * терминологических публикациях (рекомендациях, словарях) международных организаций, государственных стандартах.

Все знаковые и языковые средства в работах должны соответствовать нормам и правилам русского языка (лексическим, словообразовательным, синтаксическим, стилистическим). Не допускается применение оборотов разговорной речи, техницизмов и профессионализмов.

14.2.3. Требования к выполнению творческого задания, выполняемого в форме презентации

При создании презентации необходимо определить:

- конкретное количество слайдов, цель и содержание каждого из них;
- основные объекты, которые будут размещены на каждом слайде.

Также необходимо соблюдать следующие требования к оформлению мультимедийных презентаций, а именно:

1. Требования к стилю:

- соблюдайте единый стиль оформления;
- избегайте стилей, которые будут отвлекать от самой информации;
- вспомогательная информация не должна преобладать над основной;

2. Фон: для фона следует выбирать холодные тона (синий, зеленый).

3. Цвет: на одном слайде рекомендуется использовать не более трех цветов: один для фона, один для заголовков, один для текста. Для фона и текста следует использовать контрастные цвета.

4. Анимационные эффекты: не рекомендуется злоупотреблять различными анимационными эффектами, они не должны отвлекать внимание от содержания информации на слайде.

5. Представление информации на слайдах:

- необходимо использовать короткие предложения и слова;
- заголовки должны привлекать внимание аудитории;
- предпочтительно горизонтальное расположение информации;
- наиболее важная информация должна располагаться в центре экрана.

6. Шрифты:

- для заголовка – не менее 24 кегля;
- для информации – 16-18 кеглей;
- нельзя смешивать разные типы шрифтов в одной презентации;
- для выделения информации следует использовать жирный шрифт, курсив или подчеркивание.

7. Объем информации:

- не стоит заполнять один слайд слишком большим объемом информации;
- наибольшая эффективность достигается тогда, когда ключевые пункты отображаются по одному на каждом отдельном слайде.

Для обеспечения разнообразия следует использовать разные виды слайдов: с текстом,
с таблицами, с диаграммами.

15. Перечень основной и дополнительной литературы, ресурсов интернет, необходимых для освоения дисциплины

а) основная литература:

№ п/п	Источник
1	Уколов, А.И. Оценка рисков : учебник / А.И. Уколов. - 2-е изд. стер. - Москва : Директ-Медиа, 2017. - 627 с. : ил., схем., табл. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-4475-2589-7 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=445268
2	Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент : учебник / А.Н. Фомичев. - 4-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2016. - 372 с. : ил. - (Учебные издания для бакалавров). - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-394-02676-8 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=453893

б) дополнительная литература:

№ п/п	Источник
3	Бабичева, Надежда Эвальдовна. Теоретико-методологические основы экономического анализа развития организаций на основе ресурсного подхода : монография / Н.Э. Бабичева. — Москва : Издательский дом "Финансы и Кредит", 2012. — 255 с. : ил., табл. — Библиогр.: с.242-255. — ISBN 978-5-8024-0096-8.
4	Балдин, К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К.В. Балдин, И.И. Передеряев, Р.С. Голов. - 3-е изд. - Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2017. - 418 с. : ил. - Библиогр. в кн. - ISBN 978-5-394-02256-2 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=454050
5	Ендовицкий, Дмитрий Александрович. Инвестиционный анализ в реальном секторе экономики : Учебное пособие для студентов, обучающихся по специальностям "Финансы и кредит", "Бух. учет, анализ и аудит", "Мировая экономика" / Д.А. Ендовицкий ; Под ред. Л.Т. Гиляровской. — М. : Финансы и статистика, 2003. — 351,[1] с. : ил., табл. — Библиогр.: с.345-350. — ISBN 5-279-02501-1.
6	Инвестиции в странах БРИК : оценка риска и корпоративного управления в Бразилии, России, Индии и Китае / Под редакцией: Бородина С., Швырков О. – М.: Альпина Паблшер, 2016/– 356 с. – ISBN: 978-5-9614-1146-1. – <URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=254597&sr=1 >.
7	Круи, Мишель. Основы риск-менеджмента = The Essentials of risk management : [учебное пособие для подготовки к экзамену на получение сертификата Associate PRM] : [пер. с англ.] / М. Круи, Д. Галай, Р. Марк ; науч. ред. В.Б. Минасян. — М. : Юрайт, 2011. — 389, [1] с. : ил., табл. — ISBN 8-978-5-9916-0868-8.
8	Уколов, А.И. Управление корпоративными рисками: инструменты хеджирования : учебник / А.И. Уколов, Т.Н. Гупалова. - 2-е изд., стер. - Москва : Директ-Медиа, 2017. - 554 с. : ил., схем., табл. - Библиогр.: с. 547. - ISBN 978-5-4475-9318-6 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=273678

в) информационные электронно-образовательные ресурсы (официальные ресурсы интернет):

№ п/п	Ресурс
1	Национальный цифровой ресурс «РУКОНТ» – <URL: http://rucont.ru/ >
2	ЭБС Издательства «Лань» – <URL: http://www.e.lanbook.com/ >
3	ЭБС «Университетская библиотека Online» – <URL: http://www.biblioclub.ru/ >
4	Электронный университет https://edu.vsu.ru/

16. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы

№ п/п	Источник
1	Конспекты лекций, размещенные на https://edu.vsu.ru/
2	Задания для практических занятий, размещенные на https://edu.vsu.ru/

17. Информационные технологии, используемые для реализации учебной дисциплины, включая программное обеспечение и информационно-справочные системы (при необходимости)

Дисциплина реализуется с применением элементов электронного обучения и дистанционных образовательных технологий (ЭОиДОТ) («Электронный университет» [Бабичева Н.Э. ЭУК «Управление рисками»](#). – URL: <https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=9355>).

Облачные сервисы справочно-правовых систем: «КонсультантПлюс». «ГАРАНТ»
Электронный ресурс Министерства финансов РФ. – URL :<http://minfin.ru>

Электронный ресурс Росстата. – URL :<http://www.gks.ru>

Электронный ресурс научной электронной библиотеки eLIBRARY.RU. – URL :
<https://elibrary.ru/defaultx.asp>

Электронный ресурс программной системы для обнаружения текстовых заимствований в учебных и научных работах «Антиплагиат.ru». – URL :
<https://www.antiplagiat.ru>

Электронный ресурс СПС «ГАРАНТ-Образование» . – URL : <https://edu.garant.ru>

Электронный ресурс. СПС "Консультант Плюс" для образования. – URL :
<https://student2.consultant.ru/cgi/online.cgi?req=home;rnd=0.0009447578917360921>

Программное обеспечение

OfficeSTD 2013 RUS OLP NL Acdmc,

WinSvrStd 2012 RUS OLP NL Acdmc 2Proc,

WinPro 8 RUS Upgrd OLP NL Acdmc,

Неисключительные права на ПО Dr. Web Enterprise Security Suite Комплексная защита Dr. Web Desktop Security Suite

С ноября 2020 :

Office Standard 2019 Single OLV NL Each AcademicEdition Additional Product,

Win Pro 10 32-bit/64-bit All Lng PK Lic Online DwnLd NR

18. Материально-техническое обеспечение дисциплины:

Библиотечный фонд (отдел обслуживания исторического факультета международных отношений ЗНБ ГОУ ВПО ВГУ), аудитории с мультимедийным оборудованием для проведения лекционных и практических занятий, компьютерный класс с доступом в Интернет (Ноутбук, экран для проектора, проектор).

19. Фонд оценочных средств:

19.1. Перечень компетенций с указанием этапов формирования и планируемых результатов обучения

Код и содержание компетенции (или ее части)	Планируемые результаты обучения (показатели достижения заданного уровня освоения компетенции посредством формирования знаний, умений, навыков)	Этапы формирования компетенции (разделы (темы) дисциплины или модуля и их наименование)	ФОС* (средства оценивания)
ПК-11	<i>знать</i> : теоретические и методические основы оценки элементов риска, моделей и механизмов управления рисками на предприятиях; разработки и выбора	Тема 1. Теоретические основы управления рисками	Комплект вопросов для подготовки к научной дискуссии № 1

риск-стратегий с учетом критериев социально-эколого-экономической эффективности и прогнозирования возможных социально-экономических последствий	Тема 2. Методология риск-менеджмента	Комплект вопросов для подготовки к научной дискуссии № 2
	Тема 3. Методы оценки и анализа рисков экономической деятельности хозяйствующих субъектов	Комплект вопросов для подготовки к научной дискуссии № 3
	Тема 4. Учет неопределенности и риска при оценке эффективности проектов	Комплект вопросов для подготовки к научной дискуссии № 4
	Тема 5. Разработка риск-стратегии и контроль за ее реализацией	Комплект вопросов для подготовки к научной дискуссии № 5
<i>уметь: применять</i> основные методы и методологию построения корпоративной системы риск-менеджмента, разработки риск-стратегий в целях создания рациональных механизмов и моделей управления рисками с учетом социальной и экологической составляющей корпоративной ответственности	Тема 1. Теоретические основы управления рисками	Комплект задач и практических ситуаций № 1
	Тема 2. Методология риск-менеджмента	Комплект задач и практических ситуаций № 2
	Тема 3. Методы оценки и анализа рисков экономической деятельности хозяйствующих субъектов	Комплект задач и практических ситуаций № 3
	Тема 4. Учет неопределенности и риска при оценке эффективности проектов	Комплект задач и практических ситуаций № 4
	Тема 5. Разработка риск-стратегии и контроль за ее реализацией	Комплект задач и практических ситуаций № 5
<i>владеть</i> (иметь навыки): основными методами и методологией оценки и контроля за функционированием корпоративной системы риск-менеджмента, разработки и оценки эффективности реализации риск-стратегий в целях создания механизмов и моделей управления рисками с учетом социальной и экологической составляющей корпоративной ответственности	Тема 3. Методы оценки и анализа рисков экономической деятельности хозяйствующих субъектов	Комплект заданий для аудиторской контрольной работы
	Тема 4. Учет неопределенности и риска при оценке эффективности проектов	
	Тема 5. Разработка риск-стратегии и контроль за ее реализацией	
Промежуточная аттестация		КИМ

19.2 Описание критериев и шкалы оценивания компетенций (результатов обучения) при промежуточной аттестации

Для оценивания результатов обучения на зачете используются следующие показатели:

- 1) знание теоретических основ, определяющих концепцию риск-менеджмента; классификационных признаков и элементов корпоративных рисков; методологию построения корпоративной системы риск-менеджмента и системы контроля за ее функционированием, разработки и выбора риск-стратегий с учетом социальной и экологической составляющих корпоративной социальной ответственности в местах осуществления международной деятельности;
- 2) понимание теоретических и методических основ оценки элементов риска, моделей и механизмов управления рисками на предприятиях, разработки и выбора риск-стратегий с учетом критериев социально-эколого-экономической эффективности и прогнозирования возможных социально-экономических последствий;
- 3) способность на практике принимать организационно-управленческие решения относительно выбора варианта построения корпоративной системы управления рисками, а также риск-стратегий с учетом социальной и экологической составляющей корпоративной ответственности;
- 4) умение: применять основные методы и методологию построения корпоративной системы риск-менеджмента, разработки риск-стратегий в целях создания рациональных механизмов и моделей управления рисками с учетом социальной и экологической составляющей корпоративной ответственности;
- 5) владение основными методами и методологией построения корпоративной системы риск-менеджмента, разработки риск-стратегий в целях создания рациональных механизмов и моделей управления рисками с учетом социальной и экологической составляющей корпоративной ответственности;
- 6) применение на практике основных методов и методологии оценки и контроля за функционированием корпоративной системы риск-менеджмента, оценки эффективности реализации риск-стратегий в целях создания механизмов и моделей управления рисками с учетом социальной и экологической составляющей корпоративной ответственности

Для оценивания результатов обучения на зачете используется 2-балльная шкала: зачтено / не зачтено. Оценка «зачтено» представляет собой средний показатель оценок «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно» за выполнение заданий из фонда оценочных средств.

Соотношение показателей, критериев и шкалы оценивания результатов обучения

Критерии оценивания компетенций	Уровень сформированности компетенций	Шкала оценок
<p><i>Полное соответствие ответа или результата решения обучающегося на контрольно-измерительный материал пяти перечисленным показателям. Компетенции сформированы полностью: обучающийся в полной мере владеет теоретическими основами риск-менеджмента, способен иллюстрировать ответ примерами и фактами хозяйственной жизни конкретных экономических субъектов, результатами научных исследований, применять теоретические знания для решения практических задач владеет в полном объеме аналитическим инструментарием риск-менеджмента для решения практических задач и ситуаций, исчерпывающе, грамотно и логически строит ответы;</i></p>	<p><i>Повышенный или базовый уровень</i></p>	<p><i>Зачтено</i></p>

<i>правильно обосновывает принятые решения. Допускаются незначительные. Допускаются неточности в ответах и погрешности в расчетах (не более 10% в ответе)</i>		
<i>Ответ на контрольно-измерительный материал не соответствует трем из перечисленных показателей. Обучающийся демонстрирует отсутствие знаний теоретического материала, навыков и умений; допускает грубые ошибки в ответах и определениях; нарушает последовательность в изложении материала и решении задач</i>	<i>Не сформирован</i>	<i>Не зачтено</i>

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

19.3.1 Перечень вопросов и практических заданий к зачету:

1. Цели и задачи, предмет управления рисками.
2. Сущность и причины возникновения рисков.
3. Классификация корпоративных рисков.
4. Элементы риска.
5. Финансовые риски.
6. Коммерческие риски.
7. Риски операционной деятельности.
8. Экологические и социальные риски.
9. Концепция риск-менеджмента: сущность и содержание.
10. Принципы риск-менеджмента.
11. Системный подход к управлению рисками.
12. Процессный подход к управлению рисками.
13. Организационные аспекты построения системы риск-менеджмента.
14. Этапы процесса управления рисками.
15. Юридические методы управления рисками.
16. Организационные методы управления рисками.
17. Производственно-технологические методы управления рисками.
18. Экономические методы управления рисками.
19. Экологические методы управления рисками.
20. Социальные методы управления рисками.
21. Качественные методы идентификации и оценки рисков (мозговой штурм, метод экспертных оценок, метод аналогий, Delphi-метод, SWOT-анализ и т.п.).
22. Количественные методы идентификации и оценки вероятности возникновения рисков.
23. Методика построения карты рисков.
24. Анализ чувствительности.
25. Ресурсный подход в идентификации и оценке риска.
26. Диагностика предполагаемых последствий риска.
27. Методы учета фактора неопределенности (проверка устойчивости, корректировка параметров проекта и экономических нормативов, формализованное описание неопределенности).
28. Прогнозирование рисков ситуации на основе статистической выборки.
29. Прогнозирование риска потери финансовой устойчивости и банкротства.
30. Укрупненная оценка устойчивости проекта в целом.

31. Оценка границ безубыточности проекта.
32. Оценка устойчивости проекта путем варьирования его параметров.
33. Оценка ожидаемой эффективности проекта с учетом количественных характеристик неопределенности.
34. Организация процесса выбора риск-стратегии.
35. Стратегия уклонения от рисков.
36. Стратегия распределения рисков.
37. Стратегия хеджирования рисков.
38. Стратегия страхования рисков.
39. Стратегия принятия и удержания рисков.
40. Стратегия лимитирования рисков.
41. Стратегия диверсификации рисков
42. Стратегия самострахования.
43. Стратегия локализации рисков
44. Оценка системы контроля за реализацией риск-стратегии

Примерный комплект заданий представлен в разделе 19.3.3.

19.3.2 Комплект вопросов для подготовки к научной дискуссии

Комплект вопросов № 1 по теме: Теоретические основы управления рисками

1. Риск: сущность риска, факторы, событие риска, последствия риска.
2. Условия риска как объективные условия деятельности и развития организации.
3. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
4. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.
5. Концепция конфликта целей в организации.
6. Неопределенность, ее роль в развитии организации.
7. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.
8. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска.
9. Существенные признаки рисков. Влияние риска на эффективность управления.
10. Управление рисками и регулирование рисков.
11. Управленческое решение как объект управления рисками.
12. Управление рисками на индивидуальном уровне: основные характеристики объекта управления.
13. Организация как объект управления рисками.
14. Экономическая автономность, рискозащищенность. Модели экономической рискозащищенности.
15. Классификация факторов риска по степени непосредственного воздействия на эффективность управления.
16. Структурные и процессуальные факторы риска: проблемы идентификации и оценки.
17. Динамика факторов риска как показатель кризисного развития процессов.
18. Организации как системы: использование типологии организационных систем в управлении рисками.
19. Использование теории жизненного цикла организации при анализе и планировании рисков.
20. Подходы к управлению рисками: интенсивный, экстенсивный.

21. Роль субъекта при разработке решений в условиях риска.
22. Типология субъектов управленческих решений по степени склонности к риску. Субъективная оценка вероятности риска и ожидаемых потерь.
23. Принцип приемлемого риска.
24. Классификации рисков в управлении: признаки классификации, принципы использования.
25. Взаимосвязь структурных и процессных рисков в управлении организацией.
26. Аксиоматика управления рисками.
27. Виды деятельности по управлению рисками.
28. Взаимосвязь планирования в управлении рисками и планирования развития организации.
29. Метод избежания рисков.
30. Метод принятия рисков на себя.
31. Метод предотвращения убытков.
32. Метод уменьшения размера убытков.
33. Метод страхования.
34. Метод самострахования.
35. Метод передачи рисков.
36. Принципы использования и комбинирования методов управления рисками.
37. Методологические принципы оценки рисков.
38. Методические и операционные принципы оценки рисков.
39. Количественные методы оценки рисков.
40. Качественные методы оценки рисков.
41. Использование моделирования в управлении рисками.
42. Определение величины потерь от реализации риска по наличным денежным средствам и ценным бумагам.
43. Уточнение стратегии организации при разработке программы управления рисками.
44. Предварительный отбор рисков при разработке программы управления рисками.
45. Разработка плана превентивных мероприятий программы управления рисками.
46. Анализ рисков как этап разработки программы управления рисками.
47. Контроль и пересмотр программы управления рисками.
48. Оценка эффективности программы управления рисками.
49. Получение, анализ, хранение и использование информации в целях управления рисками.
50. Использование технических инноваций для повышения эффективности управления рисками.
51. Особенности управления рисками в финансовой и инвестиционной сферах деятельности организации.
52. Риск в управлении прямыми и портфельными инвестициями.
53. Распределение рисков между участниками проекта.
54. Классификация рисков производственной деятельности.
55. Особенности управления рисками взаимодействия с контрагентами в производственной деятельности организации.
56. Роль системы обеспечения безопасности производства в снижении рисков.

Комплект вопросов № 2 по теме: Методология риск-менеджмента

1. Основные этапы эволюции теории управления рисками во взаимосвязи с рисками.

2. Синтез системного и процессного подходов к управлению рисками и угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
3. Использование теории жизненного цикла организации при анализе и планировании рисков.
4. Принципы риск-менеджмента в управлении рисками.
5. Статическая и динамическая концепция в управлении рисками и угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
6. Особенности применения стандартов риск-менеджмента в корпоративном управлении рисками.
7. Этапы риск менеджмента и их интеграция в систему управления рисками.
8. Использование юридических методов в управлении рисками и угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
9. Использование организационных методов в управлении рисками и угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
10. Использование экономических методов в управлении рисками и угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
11. Использование производственно-технологических методов в управлении рисками и угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
12. Использование экологических методов в управлении рисками и угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
13. Использование социальных методов в управлении рисками и угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
14. Информационное обеспечение оценки рисков и угроз экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
15. Информационное обеспечение прогнозирования рисков и угроз экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
16. Использование комплексного подхода в прогнозировании рисков и угроз экономической безопасности хозяйствующих субъектов.

Комплект вопросов № 3 по теме: Методы оценки и анализа рисков экономической деятельности хозяйствующих субъектов

1. Качественные методы идентификации и оценки рисков: преимущества и недостатки использования.
2. Идентификация и оценка вероятности возникновения рисков при построения карты рисков.
3. Подходы к анализу чувствительности рисков.
4. Ресурсный подход в оценке рисков и угроз экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
5. Сравнительный анализ существующих подходов к определению точки безубыточности и зон экономической безопасности.
6. Сравнительный анализ методик оценки рисков рейтинговых агентств и их возможность применения в управлении рисками.
7. Реализация метода Монте-Карло в управлении рисками
8. Реализация метода VaR в управлении рисками.
9. Использование модели Value at Risk в управлении рисками
10. Адаптация модели Shortfal в управлении рисками
11. Применение модели У. Шарпа в системе управления рисками
12. Использование модели Е. Фамы и К. Френча в управлении рисками
13. Адаптация модели С. Росса в управлении рисками
14. Применение модели Ф.Блека и М.Шоулза в управлении рисками
15. Метод построения дерева решений в управлении рисками
16. Использование моделирования в управлении рисками.

Комплект вопросов № 4 по теме: Учет неопределенности и риска при оценке эффективности проектов

1. Методы учета фактора неопределенности при оценке эффективности проектов.
2. Укрупненная оценка устойчивости проекта в целом.
3. Оценка границ безубыточности и устойчивости проекта путем варьирования его параметров.
4. Оценка ожидаемой эффективности проекта с учетом количественных характеристик неопределенности.

Комплект вопросов № 5 по теме: Разработка риск-стратегии и контроль за ее реализацией

1. Этапы проектных работ.
2. Диагностика банкротства и прогнозирование последствий рисков.
3. Методы учета фактора неопределенности.
4. Виды деятельности по управлению рисками.
5. Взаимосвязь планирования в управлении рисками и планирования развития организации с учетом требований экономической безопасности.
6. Метод избежания рисков.
7. Метод принятия рисков на себя.
8. Метод предотвращения убытков.
9. Метод уменьшения размера убытков.
10. Метод страхования.
11. Метод самострахования.
12. Метод передачи рисков.
13. Уточнение стратегии организации при разработке программы управления рисками.
14. Предварительный отбор рисков при разработке программы управления рисками.
15. Разработка плана превентивных мероприятий программы управления рисками.
16. Анализ и прогнозирование рисков как этап разработки программы управления рисками.
17. Контроль и пересмотр программы управления рисками.
18. Оценка эффективности программы управления рисками.
19. Использование показателей бухгалтерской (финансовой) и интегрированной отчетности в управлении рисками угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
20. Применение технических инноваций в управлении рисками и угрозами экономической безопасности хозяйствующих субъектов.
21. Особенности управления рисками в финансовой и инвестиционной сферах деятельности организации.
22. Роль системы обеспечения экономической безопасности производственной деятельности в снижении рисков.

Критерии оценок:

5 – обучающийся демонстрирует высокий (углубленный) уровень сформированности компетенций: компетенции сформированы полностью, проявляются и используются систематически, в полном объеме, правильно изложен дискуссионный вопрос материал; приводит практические примеры в качестве доказательств.

Обучающийся исправляет после замечания преподавателя; Обучающийся правильно отвечает на дополнительные вопросы преподавателя, имеющие целью выяснить степень понимания обучающимся данного материала;

4 – обучающийся демонстрирует повышенный (продвинутой) уровень сформированности компетенций: компетенции в целом сформированы, но проявляются и используются фрагментарно, не в полном объеме, неполно изложено содержание дискуссионного вопроса (не менее 70 % от полного), при изложении допущена одна существенная ошибка; допущены неточности при формулировке понятий; решение задачи выстроено недостаточно логично и последовательно;

3 – обучающийся демонстрирует пороговый (базовый) уровень сформированности компетенций: компетенции сформированы в общих чертах, проявляются и используются ситуативно, частично, показывает знания только теоретического материала; изложение выстроено недостаточно логично и последовательно;

2 – пороговый (базовый) уровень компетенций не сформирован неполно изложено решение (менее 50 % от полного), при изложении были допущены 2-3 существенные ошибки; нарушена логика и последовательность решения задачи.

19.3.3 Комплект задач и практических ситуаций Комплект задач и практических ситуаций № 1

Для решения задач и выполнения практических ситуаций необходимо выбрать вид экономической деятельности (в соответствии с номером зачетной книжки).

1. Сельское хозяйство: свиноводство.
2. Рыболовство.
3. Туризм.
4. Гостиничное хозяйство.
5. Банки.
6. Страховые организации.
7. Добыча нефти.
8. Добыча газа.
9. Строительство и обслуживание атомных станций.
10. Строительство зданий.
11. Авиаперевозки.
12. Железнодорожные перевозки.
13. Производство кинофильмов.
14. Оптовая торговля продовольственными товарами.
15. Оптовая торговля непродовольственными товарами.
16. Реклама.
17. Производство фармацевтических препаратов.
18. Лизинг.
19. Аутсорсинг.
20. Оказание медицинских услуг.
21. Производство молочных продуктов.
22. Производство детского питания.
23. Производство табачных изделий.
24. Производство текстильных изделий.
25. Производство одежды.
26. Производство кожи и изделий из кожи.
27. Обработка древесины.
28. Производство бумаги и бумажных изделий.

29. Деятельность полиграфическая.
30. Производство кокса и нефтепродуктов.
31. Производство химических веществ и химических продуктов.
32. Производство БАДов.
33. Производство резиновых и пластмассовых изделий.
34. Производство минеральной воды.
35. Производство чугуна и стали.
36. Производство металлоконструкций.
37. Производство компьютеров.
38. Производство электрического оборудования.
39. Производство автомобилей.
40. Производство прицепов и полуприцепов.
41. Производство мебели.
42. Производство медицинского оборудования.
43. Пошив дизайнерской одежды.
44. Производство и передача электрической энергии.
45. Почтово-курьерская деятельность.
46. Деятельность негосударственных пенсионных фондов.
47. Сельское хозяйство: зерноводство.
48. Сельское хозяйство: птицеводство
49. Логистическая деятельность.
50. Производство строительных материалов.

Задание 1.1. Используя интернет ресурсы, необходимо осуществить сбор, обработку и систематизацию статистической информации, необходимую для проведения анализа и оценки рисков по заданному виду деятельности.

Список интернет ресурсов

1. Trading Economics (<https://ru.tradingeconomics.com/russia/gdp>);
2. IEA International Energy Agency (<http://www.iea.org/statistics/statisticssearch/report/?year=2014&country=RUSSIA&product=Balances>);
3. Федеральная служба государственной статистики (<http://www.gks.ru>);
4. AIRMIC: Ассоциация страховщиков и риск-менеджеров (www.airmic.com);
5. ARIA: Американская ассоциация по страхованию и рискам (www.aria.org);
6. ASSE: Американское общество инженеров по охране труда (www.asse.org);
7. CAS: Страховое общество по рискам потерь (www.casact.org);
8. CIRANO: Центр межуниверситетских исследований и анализа организаций (Канада) (www.cirano.qc.ca);
9. FERMA: Федерация европейской ассоциации риск-менеджеров (www.ferma-asso.org) (также связана с IFRIMA, Международной ассоциации риск-менеджеров и страховщиков);
10. FEI: Институт финансовых руководителей (Северная Америка) (www.fei.org);
11. GARP: Всемирная ассоциация профессионалов риск-менеджмента (www.garp.com);
12. IIA: Институт внутренних аудиторов (аудит/контроль, управление) (www.theiia.org);
13. IRM: Институт управления рисками (всемирное страхование) (www.theirm.org);
14. NACD: Национальная ассоциация управляющих (www.nacdonline.org);
15. PRIMA: Открытая ассоциация по риск-менеджменту (www.primacentral.org);
16. PRMIA: Международная ассоциация риск-менеджеров (www.prmia.org);
17. RAPA: Ассоциация по оценке рисков и полисов (www.piercelaw.edu/risk/rapa.htm);
18. RMA: Ассоциация по риск-менеджменту (кредитные риски) (www.rmahq.org);

19. RIMS: Общество по управлению рисками и страхованию (www.rims.org);
20. SOA: Сообщество актуариев (www.soa.org);
21. SRA: Сообщество по анализу рисков (www.sra.org);
22. Научные центры;
23. Центр по управлению рисками (часть «Ресурсов для будущего», Вашингтон) (www.rff.org);
24. Университет штата Джорджия – центр управления рисками на предприятиях и в сфере страховых услуг (www.cermas.gsu.edu);
25. Гарвардский университет – центр анализа рисков (www.hcra.harvard.edu);
26. Лондонская школа экономики – центр риск-менеджмент и управление (www.lse.ac.uk);
27. Университет Монеш (Monash) – Австралийский филиал по управлению рисками (flexlearn@buseco.monash.edu.au);
28. Университет Колорадо – институт природных инцидентов (www.colorado.edu/hazards);
29. Университет Пенсильвании – управление рисками и центр принятия решений (<http://grace.Wharton.upenn.edu/risk/>);
30. Университет Ватерлоо – институт по исследованию рисков (<http://irr.uwaterloo.ca>);
31. Совет по риск-менеджменту - (www.conferenceboard.ca);
32. Совет главных риск-менеджеров - (www.conferenceboard.ca);
33. Дискуссионная группа членов IRM – в основном страхование (www.theirm.org);
34. Информационная ассоциации по риск-менеджменту – дискуссионная группа Майка Мерфи (Michael.Murphy@fin.gov.on.ca);
35. Открытый институт по рискам – периодические электронные недельные семинары по рискам (www.riskinstitute.org);
36. Группа по обсуждению рисков (www.sra.org);
37. RiskMail – главным образом страхование (www.riskmail.com);
38. Электронная группа профессионалов по рискам – в основном страхование (www.rims.org);
39. Банк по международным расчетам (материалы Basel 2) (www.bis.org);
40. Комитет главных управляющих рисками: энергетические компании (www.ccro.org);
41. COSO (Комитет спонсорских организаций): (www.erm.coso.org);
42. ERisk: много данных, ежемесячные обзоры, публикации, финансовые ссылки (www.Erisk.com);
43. Федеральное агентство по чрезвычайным ситуациям (США): (www.fema.gov/);
44. Женевская Ассоциация: страхование (www.genevaassociation.org);
45. NonprofitRiskManagementCenter: в основном о некоммерческих применениях (www.nonprofitrisk.org);
46. Открытый институт по рискам (www.riskinstitute.org);
47. Обучение в Квинсленде:
(<http://education.qld.gov.au/strategic/policy/guidelines/risk/>);
48. RiskCenter: в основном – финансовые риски (www.riskcenter.com);
49. RiskInfo: широкий спектр вопросов по управлению рисками (www.riskinfo.com);
50. RiskWorld.com (www.riskworld.com);
51. Стандарты Австралии – специальный сайт по риск-менеджменту. Информация по ANZ 4360. (www.riskmanagement.com.au);
52. Международная стратегия ООН по уменьшению числа катастроф (www.unisdr.org);
53. CFO (www.cfo.com)

54. Экономическая и портфельная стратегия (острые обзоры Питера Бернштейна по вопросам финансов и инвестирования) (www.peterlbernsteininc.com)
55. Риск на предприятиях (www.informa.com);
56. Предвидение (www.rirg.com);
57. Geneva Papers on Risk & Insurance (www.genevaassociation.org);
58. Гарвардский деловой обзор (www.hbr.org);
59. Анализ рисков (www.sra.org);
60. Риск и управление (www.lse.ac.uk);
61. Риск-менеджмент (www.rims.org);
62. Отчеты по управлению рисками (www.riskreports.com);
63. Sigma (www.swissre.com).

Задание 1.2. Используя интернет-ресурсы, необходимо сформировать отчетность организации, которую обучающийся будет использовать в качестве субъекта исследования при проведении анализа и оценки рисков.

Задание 1.3. На основе результатов задания 1.1, провести оценку отраслевого риска методом балльной оценки, используя модель $R_i = S_i * E_i * P_i$, где R – количественная оценка риска по i -ому фактору; S – величина серьезности последствий от влияния фактора; E – длительность влияния; P – вероятность последствий от влияния фактора.

Самостоятельно разработать шкалы оценки параметров в баллах (таблицы 1, 2, 3). Результаты оценки риска привести в таблице 4.

На основании полученных результатов мнений каждого эксперта (обучающегося) рассчитать коэффициент конкордации Кендалла по 4 группам факторов.

Таблица 1. Разработка шкалы оценки серьезности последствий от влияния фактора в баллах

Описание серьезности последствий от влияния фактора	Оценка последствий в баллах
Фактор не приводит к заметным последствиям	
Последствия от влияния фактора незначительны:	
Последствия от влияния фактора существенны:	
Последствия от влияния фактора значительны:	
....	
Прекращение вида экономической деятельности (исключение из ОКВЭД)	

Таблица 2. Разработка шкалы оценки длительности влияния фактора на вид экономической деятельности в баллах

Описание длительности последствий от влияния фактора	Оценка длительности влияния в баллах
Фактор не приводит к заметным последствиям во времени	
Длительность влияния фактора 1 день	
Длительность влияния фактора 3 месяца	
Длительности влияния фактора 6 месяцев	
....	

Таблица 3. Разработка шкалы определения вероятности последствий

от влияния фактора

Оценка вероятности обнаружения отказа до поставки потребителю Виды отказов по вероятности обнаружения до поставки	Оценка вероятности последствий от влияния фактора экспертным путем (0 до 1)	Оценка вероятности в баллах
Очень высокая вероятность		
Высокая вероятность		
Умеренная вероятность		
Высокая вероятность		
Очень высокая вероятность		

Таблица 4. Оценка отраслевого риска по виду экономической деятельности

Группа	Факторы, оказывающие влияние на вид экономической деятельности	Величина последствий от влияния фактора S	Величина длительности влияния E	Вероятность последствий от влияния фактора P	Индикаторы риска R
Положение вида экономической деятельности на мировом и отраслевом рынке	Рыночные котировки корпораций – участников фондового рынка и биржевые индексы				
	Биржевые индексы на материальные ресурсы и продукцию, являющиеся основой товарного рынка и вида экономической деятельности				
Оценка риска по группе					
Государственное регулирование	Степень подверженности государственному регулированию				
	Количество коррупционных скандалов				
	Степень государственной поддержки				
	Полнота нормативной базы				
	Налоговая нагрузка				

	Уровень контроля со стороны контролирующих и лицензирующих органов				
	Таможенные барьеры и размер экспортных пошлин, акцизов, НДС				
Оценка риска по группе					
Инвестиционный климат	Уровень капиталоемкости				
	Средний срок окупаемости инвестиций				
	Степень зависимости от смежных и сопутствующих видов экономической деятельности				
Оценка риска по группе					
Финансовые показатели, характеризующие состояние вида экономической деятельности	Рентабельность продукции				
	Доля занятости населения				
	Дебиторская и кредиторская задолженность				
	Выручка				
	Физический объем выпуска продукции, работ, услуг				
Оценка риска по группе					
Значение отраслевого риска по виду экономической деятельности					

Комплект задач и практических ситуаций по теме № 2

Задание 2.1. Исходя из результатов заданий темы 1, необходимо разработать модель управления рисками.

Задание 2.2. Исходя из результатов темы 1 и задания 2.1, разработать карту рисков.

Комплект задач и практических ситуаций по теме № 3

Задание 3.1. Исходя из результатов заданий темы 2, необходимо провести SWOT-анализ рисков, направленный на выявление факторов, которые оказывают влияние на возникновение рисков (вероятность наступления рисков) и создают угрозу экономической безопасности субъекта исследования.

На основе использования SWOT-анализа и других качественных методов оценки риска, представить результаты качественной оценки рисков в таблице. Сделать выводы.

Таблица Результаты анализа рисков (качественная оценка)

Идентификация риска	Факторы возникновения риска	Оценка последствий	Меры противостояния рискам

Задание 3.2. Исходя из результатов задания 3.1 и данных бухгалтерской (финансовой) отчетности, необходимо провести оценку чувствительности рисков по показателю *NPV*.

Таблица 1. Определение рейтинга факторов экономической деятельности, проверяемых на риск с точки зрения экономической безопасности хозяйствующего субъекта

Переменная X	Изменение X, %	Изменение выручки, %	Эластичность выручки	Место в рейтинге	Чувствительность (важность)	Возможность прогнозирования
...		

На основании матрицы чувствительности и прогнозируемости определить чувствительность и прогнозируемость рискового события.

Таблица 2. Матрица чувствительности и прогнозируемости

Прогнозируемость	Чувствительность риска		
	Высокая	Средняя	Низкая
Низкая	I	I	II
Средняя	I	II	III
Высокая	II	III	III

Задача 3.3.

Определить коэффициент экономической безопасности по объему производства на основании следующих данных: цена продаж единицы продукции – 30 000 руб., переменные расходы на единицу продукции – 16 000 руб., постоянные расходы – 320 000 руб., запланированные объем производства продукции - 30 единиц.

Задание 3.4.

Используя ресурсный подход, на основании данных бухгалтерской (финансовой) отчетности, определить риск а) потери платежеспособности; б) потери финансовой устойчивости.

Задание 3.5.

Определить точки безубыточности и зоны экономической безопасности, если цена продаж единицы продукции составит 30 тыс. руб., переменные расходы на единицу продукции - 20 тыс. руб., условно-постоянные расходы фирмы – 600 тыс. руб., запланированные объем производства продукции - 30 единиц. Прогнозируется, что в следующем периоде условно-постоянные расходы увеличатся на 15%, продаж цена вырастет на 5 %, а переменные расходы возрастут на 10%.

Задание 3.6.

1. На сайтах Банка России, Минфина РФ, рейтинговых агентств необходимо изучить методики и результаты представленных рейтингов агентств НРА, Эксперт-РА, Moody's, Standard&Poor's, Fitch, НРА.

Дать аналитический обзор на следующие вопросы:

1. Какой из представленных возможных подходов к рейтингу в наибольшей степени соответствует задачам регулирования финансового рынка и обеспечения финансовой стабильности в РФ? Приведите обоснование или предложите собственный вариант.
2. Считаете ли вы целесообразным уточнить (дополнить) лежащие в основе рейтингового метода предпосылки и условия?
3. Какие риски, порождаемые системой мэппинга (рэнкинга), можно выделить и какие меры их компенсации могли бы предложить?
4. Какие меры компенсации рисков, порождаемых системой мэппинга (рэнкинга), можно использовать в РФ?

Задание 3.7.

В целях хеджирования рыночного риска АО «Нефтьпродукт», заключила фьючерсный контракт сроком на 1 месяц, согласно которому, через 91 день должна будет поставить 1 000 баррелей сырой нефти Brent (Brent Crude Oil) по цене 70,05 долл./барр. Цена-спот на сырую нефть Brent на момент заключения контракта составляет 64,67 долл./барр. На основе метода *VaR* распределите дневные прибыли/убытки фьючерсного контракта.

Задание 3.8.

На основе данных бухгалтерской (финансовой) отчетности провести диагностику банкротства коэффициентным методом, с использованием ресурсного подхода и методике Альтмана.

Комплект задач и практических ситуаций № 4

Задание 4.1. Коммерческому банку АО «Альфа» предстоит принять решение о целесообразности кредитования корпорации АО «Черноземпродукт» Согласно данным бухгалтерской (финансовой) отчетности фактическое значение коэффициента текущей ликвидности (оплатности) равно 1,6. По статистике неплатежей, в соответствии с которой у конкурентов, оказавшихся должниками, коэффициент текущей ликвидности находится в диапазоне 0,8 ... 1,6, а у аккуратных плательщиков-конкурентов – в диапазоне 1,2 ... 2,7. Определить вероятность невыполнения потенциальным заемщиком АО «Черноземпродукт» договорных обязательств и оценить степень кредитного риска.

Задание 4.2

Проведите анализ чувствительности проекта по критерию *NPV*, *IRR* и *DPP* и на основании проведенных расчетов постройте диаграмму «роза рисков» проекта. Определите, какие критерии (факторы) наиболее подвержены риску в каждом случае. На основании расчетов по проекту строительства *Logistic-Centre* были получены следующие значения критериев (факторов) его эффективности: *NPV* = 5000 тыс. руб., *IRR* = 30%, *DPP* = 3,5 года. В ходе проведения стресс-тестирования и изменения переменных, оказывающих влияние на проект, были получены новые значения критериев его эффективности, приведенные в таблице.

Таблица. Новые значения критериев эффективности проекта *Logistic-Centre*

Переменные	Изменение переменной	Новые значения		
		<i>NPV</i>	<i>IRR</i>	<i>DPP</i>
Ставка %	10%	3500	25	4.0
Постоянные издержки	8%	3800	28	5.0

Ликвидационная стоимость	5%	4000	25	4,7
Переменные издержки	4%	4400	23	5,1
Объем реализации	5%	3500	26	4,7
Цена реализации	6%	3000	20	5,5

Задача 4.3

Исходя из определения чистой дисконтированной стоимости, определить какой проект целесообразно принять (менее рискованный).

Таблица. Исходные данные

Наименование проекта	Денежные потоки, тыс. руб.			
	1 год	2 год	3 год	4 год
А	-3000	1000	2100	4000
В	-3000	2800	3000	1000
Коэффициент дисконтирования при ставке 15%				

Задание 4.3

Предполагаемый срок реализации проекта – 3 года. Соответственно денежные потоки прогнозируются в размере 500 000 руб., 800 000. руб., 700 000 руб. Сумма инвестиций, которые вкладываются одновременно до начала реализации проекта, составляет 2 000 000 руб.. Ставка дисконта для данного проекта определена в размере 15 %. Какое влияние будут оказывать на проект условия внешней среды, если ставка дисконта изменится на 1 %.

Задание 4.4.

Корпорация рассматривает вопрос о приобретении для последующего производства патента на новый препарат. Стоимость патента составляет 2,4 млн. руб. Необходимо методом дисконтированных денежных потоков, рассчитать *NPV* и *IRR* проекта. Горизонт расчетов составляет четыре года.

Используя методы имитационного моделирования (метод Монте-Карло) определить по каким параметрам следует улучшить результаты проекта и повысить *NPV*? Являются ли объем продаж, цена, себестоимость оптимальными? Какова наилучшая комбинация этих параметров, дающая максимальный показатель *NPV*?

Таблица. Данные и показатели, необходимые для анализа рисков

Показатели	Год 0	Год 1	Год 2	Год 3	Год 4
Цена за упаковку препарата, руб.		60,0	61,0	61,5	63,0
Объем проданной продукции		800 200	970 000	980 000	1 100 000
Выручка					
Себестоимость		3 720 000	3 780 000	3 800 000	4 000 000

Валовая прибыль					
Управленческие расходы (операционные)		500 000	600 000	700 000	800 000
Прибыль от операционной деятельности					
Налог на прибыль					
Размер инвестиций	- 2 400 000				
Чистый доход (прибыль)					
Показатель NPV					
Показатель IRR					

Задание 4.5

По данным инвестиционной компании «ФИНАМ» о фактической доходности акций и доходности на индекс РТС за период с января 2017 по май 2017 г. (сформировать самостоятельно таблицу) определить ожидаемую доходность, риск и параметры рыночных моделей (α - и β -коэффициенты) для акций Газпрома (GAZP), Сбербанка (SBER) и Роснефти (ROSN). По результатам расчета построить график зависимостей доходности акций от доходности на индекс РТС с применением моделей:

- Модель Value at Risk;
- Модель Shortfall;
- Модель У. Шарпа.
- Модель Е. Фамы и К. Френча;
- Модель С. Росса;
- Модель Ф.Блека и М.Шоулза.

Комплект задач и практических ситуаций № 5

Задание 5.1.

На основе результатов решения задания 3.8 дать прогноз последствий рисков в экономической деятельности (См. задания теме № 2 «Методология риск-менеджмента»).

Задание 5.2.

На основе разработанной матрицы компетенций (задание 3.1) разработать риск-стратегию предотвращения угроз внешнеэкономической деятельности хозяйствующих субъектов»

19.3.4 Перечень заданий для контрольных работ

Комплект заданий для контрольной работы формируется на основе задач и практических ситуаций, представленных в разделах 19.3.3

Критерии оценок выполнения практико-ориентированных задач и ситуаций реконструктивного и творческих уровней на аудиторных и внеаудиторных занятиях, аудиторной контрольной работы:

5 – обучающийся демонстрирует высокий (углубленный) уровень сформированности компетенций: компетенции сформированы полностью, проявляются и используются систематически, в полном объеме, правильно изложено решение задачи; при изложении были допущены 1-2 несущественные ошибки, которые Обучающийся исправляет после замечания преподавателя; Обучающийся правильно отвечает на дополнительные вопросы преподавателя, имеющие целью выяснить степень понимания обучающимся данного материала;

4 – обучающийся демонстрирует повышенный (продвинутый) уровень сформированности компетенций: компетенции в целом сформированы, но проявляются и используются фрагментарно, не в полном объеме, неполно изложено решение (не менее 70 % от полного), при изложении допущена одна существенная ошибка; допущены неточности при формулировке понятий; решение задачи выстроено недостаточно логично и последовательно;

3 – обучающийся демонстрирует пороговый (базовый) уровень сформированности компетенций: компетенции сформированы в общих чертах, проявляются и используются ситуативно, частично, показывает знания только теоретического материала, неполно изложено решение (не менее 50 % от полного), при изложении были допущены 2-3 существенные ошибки; решение задачи выстроено недостаточно логично и последовательно;

2 – пороговый (базовый) уровень компетенций не сформирован неполно изложено решение (менее 50 % от полного), при изложении были допущены 2-3 существенные ошибки; нарушена логика и последовательность решения задачи.

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

Оценка знаний, умений и навыков, характеризующая этапы формирования компетенций в рамках изучения дисциплины осуществляется в ходе текущей и промежуточной аттестаций.

Текущая аттестация проводится в соответствии с Положением о текущей аттестации обучающихся по программам высшего образования Воронежского государственного университета. Текущая аттестация проводится в формах: научной дискуссии, выполнения практико-ориентированных задач и ситуаций реконструктивного и творческих уровней на аудиторных и внеаудиторных занятиях, аудиторной контрольной работы. Критерии и шкала оценивания по каждой форме приведены в таблицах.

Таблица 19.1. Критерии и шкала оценивания знаний при проведении научной дискуссии

Критерии оценки знаний, умений и навыков обучающегося	Уровень сформированности компетенций и шкала оценивания			
		Высокий (углубленный)	Повышенный (продвинутый)	Пороговый (базовый)

1. Правильное изложение и конкретизация (уточнение) научной проблемы	5	4 или 5	3 или 4	3 или 2
2. Логическая последовательность и научный стиль изложения	5	4 или 5	3 или 4	3 или 2
3. Демонстрирует следующие знания: – теоретических основ, определяющих концепцию риск-менеджмента; классификационных признаков и элементов корпоративных рисков; – методологию построения корпоративной системы риск-менеджмента и системы контроля за ее функционированием; – методических основ оценки элементов риска, моделей и механизмов управления рисками на предприятиях; – разработки и выбора риск-стратегий с учетом социальной и экологической составляющих корпоративной социальной ответственности в местах осуществления международной деятельности	5	5	3 или 2	3 или 2
	5	4	3 или 2	3 или 2
	5	4	3 или 2	3 или 2
	5	4	3 или 2	3 или 2
4. Наличие собственных суждений по научной проблеме, их соответствие содержания ответа обсуждаемому вопросу	5	4 или 5	4 или 3	3 или 2
5. Использование практических примеров в качестве доказательств	5	4 или 5	4 или 3	3 или 2
6. Полные и обоснованные ответы на уточняющие вопросы	5	4 или 5	4 или 3	3 или 2

7. Наличие презентаций и других наглядных материалов	5	4 или 5	4 или 3	3 или 2
Средний балл	5	4	3	2

Таблица 19.2. Критерии и шкала оценивания знаний при выполнении практико-ориентированных задач и ситуаций реконструктивного и творческих уровней на аудиторных и внеаудиторных занятиях, аудиторной контрольной работы

Критерии оценки знаний, умений и навыков обучающегося	Уровень сформированности компетенций и шкала оценивания			
	Высокий (углубленный)	Повышенный (продвинутый)	Пороговый (базовый)	Пороговый (базовый) уровень не сформирован
1. Способен самостоятельно провести формализацию задачи для принятия управленческих решений	5	4 или 5	3 или 4	3 или 2
2. Логическая последовательность и научный стиль изложения	5	4 или 5	3 или 4	3 или 2
3. Демонстрирует следующие умения и навыки: – применять на практике основные методы и методики оценки рисков; – оценивать эффективность реализации риск-стратегий; – применять основные методы и методологию построения корпоративной системы риск-менеджмента; – разрабатывать риск-стратегии в целях создания моделей управления рисками в ВЭД с учетом социальной и экологической составляющей корпоративной ответственности	5	5	3 или 2	3 или 2
	5	4	3 или 2	3 или 2
	5	4	3 или 2	3 или 2
	5	4	3 или 2	3 или 2
4. Наличие собственных суждений и выводов	5	4 или 5	4 или 3	3 или 2

5. Использование практических примеров в качестве доказательств	5	4 или 5	4 или 3	3 или 2
6. Наличие графического и табличного материалов, их оформление в соответствии с требованиями	5	4 или 5	4 или 3	3 или 2
Средний балл	5	4	3	2

Промежуточная аттестация проводится в соответствии с Положением о промежуточной аттестации обучающихся по программам высшего образования.

Контрольно-измерительные материалы промежуточной аттестации включают в себя теоретические вопросы, позволяющие оценить уровень полученных знаний и практическое задание, позволяющее оценить степень сформированности умений и навыков.

При оценивании используются количественные шкалы оценок, приведенные в табл. 19.1 и 19.2.

Программа рекомендована НМС факультета международных отношений

протокол № 6 от 17.06.2020

ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЙ

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Направление/специальность 38.03.01 «Экономика»

Дисциплина Б1.В.ДВ.17.02 Управление рисками

Профиль подготовки «Мировая экономика»

Форма обучения очная

Учебный год 2021 - 2022

Ответственный исполнитель

Зав. кафедры МЭ и ВЭД



Е.В. Ендовицкая 31.08.2020 г.

Исполнители

Профессор кафедры МЭ и ВЭД



Н.Э. Бабичева 31.08.2020 г.

СОГЛАСОВАНО

Куратор ООП ВО

по направлению/ специальности



Е.В. Ендовицкая 31.08.2020 г.

Зав. отделом обслуживания ЗНБ



М.А. Иванова 31.08.2020 г.

РЕКОМЕНДОВАНА НМС факультета международных отношений

протокол № 6 от 17.06.2020