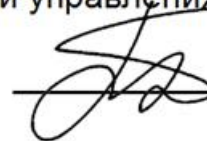


МИНОБРНАУКИ РОССИИ  
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ  
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«ВОРОНЕЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»  
(ФГБОУ ВО «ВГУ»)

**УТВЕРЖДАЮ**

Врио заведующего кафедрой  
Экономики и управления организациями



Д.В. Борзаков

14.05.2025

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**

Б1.В.ДВ.05.03 Управление рисками

- 1. Код и наименование направления подготовки:** 38.03.01 Экономика
- 2. Профиль подготовки:** Экономика предприятий и организаций
- 3. Квалификация выпускника:** бакалавр
- 4. Форма обучения:** очная
- 5. Кафедра, отвечающая за реализацию дисциплины:** Экономики и управления организациями
- 6. Составители программы:** Меняйло Галина Владимировна, к.э.н., доцент
- 7. Рекомендована:** НМС экономического факультета, протокол № 8 от 17.04.25
- 8. Учебный год:** 2027/2028      **Семестр:** 8

## 9. Цели и задачи учебной дисциплины

Целью освоения учебной дисциплины:

является формирование знаний, умений навыков по оцениванию рисков и применению рациональных методов управления рисками.

*Задачи учебной дисциплины:*

- изучение теоретических и методических основ управления рисками на предприятии;
- умение оценивать риски, связанные с реализацией принятых организационно-управленческих решений;
- исследование методов управления различными видами рисков.

**10. Место учебной дисциплины в структуре ООП:** часть, формируемая участниками образовательных отношений, дисциплина по выбору

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

Код	Название компетенции	Код(ы)	Индикатор(ы)	Планируемые результаты обучения
ПК-3	Способен оценивать результаты организационно–экономической и производственной деятельности организации и выявлять резервы повышения ее эффективности	ПК-3.1	Осуществляет обработку исходных данных, необходимых для расчета и анализа показателей деятельности организации	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- основы теории экономических рисков;</li><li>- классификацию рисков;</li><li>- методологические основы оценки рисков организации.</li></ul> <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- классифицировать риски;</li><li>- идентифицировать риски;</li><li>- провести качественную и количественную оценку риска.</li></ul> <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- качественными методами оценки рисков;</li><li>- количественными методами оценки рисков.</li></ul>
ПК-2	Способен применять рациональные подходы к осуществлению организационно–экономической и производственной деятельности организации	ПК-2.4	Участствует в реализации мер, необходимых для повышения конкурентоспособности организации	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- теоретические и методологические основы управления рисками на предприятии;</li><li>- стандарты риск-менеджмента;</li><li>- специфику управления социально-политическими, административно-законодательными, производственными, маркетинговыми и финансовыми рисками на предприятии.</li></ul> <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- выбрать и обосновать метод управления рисками;</li><li>- воздействовать на производственные, маркетинговые и финансовые риски для повышения конкурентоспособности организации.</li></ul> <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"><li>- методами управления социально-политическими, административно-законодательными, производственными, маркетинговыми и финансовыми рисками на предприятии.</li></ul>

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

Форма промежуточной аттестации зачет

13. Трудоемкость по видам учебной работы

Вид учебной работы		Трудоемкость		
		Всего	8 семестр	
			ч.	ч., в форме ПП
Аудиторные занятия		36	36	
в том числе:	лекции	18	36	
	практические	18	36	
	лабораторные			
Самостоятельная работа		36	36	
Форма промежуточной аттестации <i>зачет</i>				
Итого:		72	72	

### 13.1. Содержание дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела дисциплины	Реализация раздела дисциплины с помощью онлайн-курса, ЭУМК
<b>1. Лекции</b>			
1.1	Введение в управление рисками.	История развития дисциплины. Сущность риска и причины его возникновения. Особенности управления фирмой в условиях неопределенности. Принципы управления рисками. Организационные аспекты создания структуры управления риском на предприятии.	
1.2	Стандарты риск-менеджмента	Основные положения зарубежных и российских стандартов риск-менеджмента. Основные этапы процесса управления рисками.	
1.3	Идентификация рисков	Источники информации для идентификации рисков. Методы идентификации рисков.	Управление рисками <a href="https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641">https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641</a>
1.4	Методологические основы оценки риска.	Классификация возможных убытков предприятия. Принципы оценки рисков. Количественные и качественные методы оценки рисков.	
1.5	Методы управления рисками на предприятии	Отказ от риска. Принятие риска на себя. Снижение риска. Передача риска.	
1.6	Управление социально-политическими и административно-законодательными рисками	Активное и пассивное управление рисками. Концепция приемлемого риска. Разработка программы интегративного риск-менеджмента.	Управление рисками <a href="https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641">https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641</a>
1.7	Управление производственными рисками.	Учет политических рисков. Социальные риски: источники возникновения, методы управления. Административно-законодательные риски: причины возникновения, специфика управления..	
1.8	Управление маркетинговыми рисками	Причины возникновения, специфика управления производственными рисками: технические риски, непосредственно производственные. транспортные, реализационные риски.	
1.9	Управление финансовыми рисками	Управление финансовыми рисками: риски покупательной способности денег. Риски непредвиденных расходов. Риски необеспечения	

		хозяйственной деятельности необходимым финансированием. Риски, связанные с вложением капитала: причины возникновения, специфика управления. Венчурные фирмы.	
<b>2. Практические занятия</b>			
2.1	Введение в управление рисками	Составить таблицу с определениями понятия «риск» разных авторов, выявить общие черты и разработать свое определение. Провести систематизацию функций риска. Определить основные принципы управления рисками. Изучить формализацию процесса риск-менеджмента на предприятии.	
2.2	Стандарты риск-менеджмента	Систематизировать информацию из зарубежных и отечественных стандартов и выделить основные этапы процесса управления рисками. Организационные аспекты создания структуры управления риском на предприятии. Изучить стандарт FERMA, COSO, Российский стандарт, выявить схожие и отличные характеристики стандартов.	
2.3	Идентификация рисков	Проведение метода мозговой атаки при решении кейса «Риски УГМК» по добыче никеля в Воронежской области»	Управление рисками <a href="https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641">https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641</a>
2.4	Методологические основы оценки риска.	Подготовить доклад на один качественный и один количественный метод оценки рисков. Решение задач по оценке рисков.	
2.5	Методы управления рисками на предприятии	Активное и пассивное управление рисками. Решение кейсов.	
2.6	Управление социально-политическими и административно-законодательными рисками	Решение задач. Доклад и презентация по управлению социально-политическими и административно-законодательными рисками.	Управление рисками <a href="https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641">https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641</a>
2.7	Управление производственными рисками.	Решение задач. Доклад и презентация по управлению производственными рисками. Специфика управления производственными рисками.*	
2.8	Управление маркетинговыми рисками	Решение задач. Доклад и презентация по управлению маркетинговыми рисками. Специфика управления маркетинговыми рисками.*	Управление рисками <a href="https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641">https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641</a>
2.9	Управление финансовыми рисками.	Решение задач. Доклад и презентация по управлению финансовыми рисками. Специфика управления финансовыми рисками*	

### 13.2. Темы (разделы) дисциплины и виды занятий

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Виды занятий (количество часов)				
		Лекции	Практические	Лабораторные	Самостоятельная работа	Всего
1	Введение в управление рисками.	2	2		4	8
2	Стандарты риск-менеджмента	2	2		4	8
3	Идентификация рисков	2	2		4	8
4	Методологические основы оценки риска.	2	2		4	8
5	Методы управления рисками на предприятии	2	2		4	8

6	Управление социально-политическими и административно-законодательными рисками	2	2		4	8
7	Управление производственными рисками.	2	2		4	8
8	Управление маркетинговыми рисками	2	2		4	8
9	Управление финансовыми рисками.	2	2		4	8
	Итого:	18	18		36	72

**14. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины:** изучение основной и дополнительной литературы, работа с конспектами лекций, полное и своевременное выполнение практических заданий по всем разделам дисциплины, полученным в ходе практических занятий. Основное внимание в самостоятельной работе обучающимся необходимо уделить изучению стандартов риск-менеджмента и материалам периодической печати, посвященных проблемам управления рисками.

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

а) основная литература:

№ п/п	Источник
1	Васин С. М. Управление рисками на предприятии / С.М. Васин, В.С. Шутов .— Москва : КноРус, 2018 .— 298 с.
2	Балдин К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К.В. Балдин ; И.И. Передеряев ; Р.С. Голов. — Москва: Дашков и К, 2017 .— 418 с. — URL: <a href="http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=454050">http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=454050</a> .
3	Управление рисками на предприятии : практикум для вузов / Воронеж. гос. ун-т; сост. Г.В. Меняйло. — Воронеж : ИПЦ ВГУ, 2009. — URL: <a href="http://www.lib.vsu.ru/elib/texts/method/vsu/m09-67.pdf">http://www.lib.vsu.ru/elib/texts/method/vsu/m09-67.pdf</a>
4	Экономика и организация производства : учебное пособие / А. Ю. Кособуцкая, Н. И. Вахтина, Е. М. Исаева [и др.]. — Воронеж : Издательский дом ВГУ, 2018. — URL: <a href="http://www.lib.vsu.ru/elib/texts/method/vsu/m18-272.pdf">http://www.lib.vsu.ru/elib/texts/method/vsu/m18-272.pdf</a>

б) дополнительная литература:

№ п/п	Источник
5	Бакаева Т. Н. Управление профессиональными рисками : учебное пособие / Т.Н. Бакаева, И.А. Дмитриева, Л.В. Толмачева — Таганрог : Издательство Южного федерального университета, 2016 .— 95 с. - URL: <a href="http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=492973">http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=492973</a>
6	Гончаренко Л. П.. Риск-менеджмент / Л.П. Гончаренко, С.А. Филин ; Рос. Экон. Ун-т им. Г.В. Плеханова; под ред. Е.А. Олейникова. — Москва : КноРус, 2019 .— 215 с.
7	Коменденко С.Н. Анализ и оценка рисков / С.Н. Коменденко, К.Н. Васильева.— Воронеж : Издательский дом ВГУ, 2019 .— 118 с
8	Кудрявцев А. А. Введение в количественный риск-менеджмент : учебник / А.А. Кудрявцев, А.В. Радионов.— Санкт-Петербург : Издательство Санкт-Петербургского Государственного Университета, 2016 .— 192 с. - URL: <a href="http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=457952">http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=457952</a>
9	Родионова Е. В. Финансовая среда и управление рисками организации : конспект лекций / Е.В. Родионова.— Йошкар-Ола : ПГТУ, 2017 .— 56 с.— URL: <a href="http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=476508">http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=476508</a>
10	Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А.Н. Фомичев. — Москва : Дашков и К°, 2016 .— 372 с. - URL: <a href="http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=453893">http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=453893</a>
11	Экономика и организация производства: Учебник / Под ред. Ю.И. Трещевского, Ю.В. Вертаковой. Л.П. Пидоймо. — М.: ИНФРА-М, 2014.— 381 с.

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

№ п/п	Ресурс
12	Образовательный портал «Электронный университет ВГУ». – URL: <a href="https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641">https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=2641</a>
13	ЭБС «Университетская библиотека online»
14	ЭБС «Лань»
15	Электронно-библиотечная система (ЭБС) ВГУ <a href="https://lib.vsu.ru/?p=4&amp;t=8b">https://lib.vsu.ru/?p=4&amp;t=8b</a>

## 16. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы

№ п/п	Источник
16	Репина О. М. Риск-менеджмент : практикум / О.М. Репина.— Йошкар-Ола : ПГТУ, 2017 .— 120 с. - URL: <a href="http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=477272">http://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=477272</a>
17	Управление рисками на предприятии : практикум для вузов / Воронеж. гос. ун-т; сост. Г.В. Меняйло. – Воронеж : ИПЦ ВГУ, 2009. – URL: <a href="http://www.lib.vsu.ru/elib/texts/method/vsu/m09-67.pdf">http://www.lib.vsu.ru/elib/texts/method/vsu/m09-67.pdf</a>

**17. Образовательные технологии, используемые при реализации учебной дисциплины, включая дистанционные образовательные технологии (ДОТ, электронное обучение (ЭО), смешанное обучение):** программа курса может быть реализована с применением дистанционных образовательных технологий. При реализации дисциплины проводятся обзорные лекции, проблемные и дискуссионные семинарские занятия, решаются кейсы, выполняется индивидуальное задание. Проверка индивидуального задания может осуществляться с использованием дистанционных образовательных технологий (ДОТ).

## 18. Материально-техническое обеспечение дисциплины:

специализированная мебель, проектор, экран для проектора настенный, компьютер.

## 19. Оценочные средства для проведения текущей и промежуточной аттестаций

Порядок оценки освоения обучающимися учебного материала определяется содержанием следующих разделов дисциплины:

№ п/п	Наименование раздела дисциплины (модуля)	Компетенция(и)	Индикатор(ы) достижения компетенции	Оценочные средства
1	Введение в управление рисками.	ПК-3 Способен оценивать результаты организационно-экономической и производственной деятельности организации и выявлять резервы ее повышения эффективности. ПК-2 Способен применять рациональные подходы к осуществлению организационно-экономической и производственной деятельности организации	ПК-3.1	Индивидуальное задание
2	Стандарты риск-менеджмента		ПК-2.4	
3	Идентификация рисков		ПК-3.1	
4	Методологические основы оценки риска.		ПК-3.1	
5	Методы управления рисками на предприятии		ПК-2.4	
6	Управление социально-политическими и административно-законодательными рисками		ПК-2.4	
7	Управление производственными рисками.		ПК-2.4	
8	Управление маркетинговыми рисками		ПК-2.4	

9	Управление финансовыми рисками		ПК-2.4	
Промежуточная аттестация форма контроля –зачет				Тестовые закрытые и открытые задания

## 20. Типовые оценочные средства и методические материалы, определяющие процедуры оценивания

### 20.1. Текущий контроль успеваемости

Текущий контроль успеваемости по дисциплине осуществляется с помощью следующих оценочных средств: контрольная работа и индивидуальное задание.

Текущая аттестация проводится в соответствии с Положением о текущей аттестации обучающихся по программам высшего образования Воронежского государственного университета.

#### Индивидуальное задание "Управление рисками на примере российского предприятия"

##### Описание технологии проведения

Цель - овладение навыками идентификации, оценки и управления рисками. Задание выполняется на примере одного из российских предприятий. Результаты анализа представляются в форме аналитического отчета. Задание выполняется индивидуально. Результаты анализа представляются в форме аналитического отчета.

Выбрать объект исследования (российское предприятие). Подготовить отчет и презентацию.

- 1) Идентифицировать риски предприятия, распределить их на идентификационной карте по вероятности возникновения и степени влияния.
- 2) Оценить один из идентифицированных рисков.
- 3) Определить стратегию управления рисками предприятия.
- 4) Выбрать и обосновать методы управления рисками.

Метод управления	Риск	Описание метода
Отказ от риска		
Принятие риска		
Снижение риска		
Передача риска		

##### Требования к выполнению заданий (или шкалы и критерии оценивания)

Задание выполняется индивидуально Оформление должно соответствовать требованиям, предъявляемым к оформлению.

Титульный лист установленной формы. Шрифт Times New Roman, размер шрифта 14, абзацный отступ 1,5, межстрочный интервал 1,5. Размеры полей: левое 3 см, правое 1 см, верхнее и нижнее 2 см. Номер страницы проставляют внизу по центру. Там, где это необходимо, в качестве аналитического инструмента можно использовать графики, диаграммы и таблицы, которые должны быть оформлены в соответствии с требованиями ГОСТ.

Критерии оценивания:

Критерии оценивания	Шкала оценок
обучающийся выполнил индивидуальное задание в полном объеме, то есть выполнил 4 задания без ошибок	Отлично (5 баллов)
если обучающийся выполнил индивидуальное задание не в полном объеме, то есть 3 задания, но без ошибок	Хорошо (4 балла)
если обучающийся выполнил индивидуальное задание не в полном объеме, то есть 2 задания, но без ошибок	Удовлетворительно (3 балла)
если обучающийся не выполнил индивидуальное задание, то есть выполнил менее чем 2 задания	Неудовлетворительно (2 балла)

## 20.2. Промежуточная аттестация

Промежуточная аттестация по дисциплине осуществляется с помощью следующих оценочных средств:

- закрытые (тестовые) задания,
- открытые задания.

При выставлении итоговой оценки по дисциплине также учитываются результаты прохождения текущих аттестаций – индивидуальное задания.

### 20.2.1 Описание технологии проведения

#### 20.2.1.1 Примеры закрытых (тестовых) заданий:

**ЗАДАНИЕ 1.** Если коэффициента вариации находится в интервале от 0,3 до 1

- риск отсутствует
- незначительный риск
- умеренный риск
- значительный риск

Ответ: умеренный риск

**ЗАДАНИЕ 2.** Если коэффициента вариации равен 0

- риск отсутствует
- незначительный риск
- умеренный риск
- значительный риск

Ответ: риск отсутствует

**ЗАДАНИЕ 3.** Если коэффициента вариации находится в интервале от 0 до 0,3

- риск отсутствует
- незначительный риск
- умеренный риск
- значительный риск

Ответ: незначительный риск

**ЗАДАНИЕ 4.** Если коэффициента вариации больше 1

- риск отсутствует
- незначительный риск
- умеренный риск
- значительный риск

Ответ: значительный риск

**ЗАДАНИЕ 5.** Характеристикой конкретного риска, которая показывает максимально возможное колебание определенного параметра от его средне-ожидаемого значения является:

- коэффициент вариации
- среднеквадратическое отклонение
- математическое ожидание
- относительное недостижение цели

Ответ: среднеквадратическое отклонение

**ЗАДАНИЕ 6.** К качественным методам оценки рисков относятся



- Марковский анализ
- Метод Монте-Карло
- Диаграмма Исикавы
- Статистический метод

Ответ: Диаграмма Исикавы

ЗАДАНИЕ 7 Простой схематический способ описания и анализа путей реализации риска (от опасности до последствий и результатов) – это метод:

- анализ «галстук -бабочка»
- статистический метод
- диаграмма Исикавы
- дерево решений

Ответ: анализ «галстук -бабочка»

ЗАДАНИЕ 8. Какой метод позволяет обобщить мнение экспертов и провести независимый анализ и голосование экспертов

- мозговой атаки
- Метод Дельфи
- контрольные листы
- анализ «галстук -бабочка»

Ответ: Метод Дельфи

ЗАДАНИЕ 9. Какой метод управления рисками является наиболее эффективным, когда велики вероятность возникновения убытков и возможный размер убытка:

- принятие рисков
- передача рисков
- отказ от рисков
- снижение риска

Ответ: отказ от рисков

ЗАДАНИЕ 10. Выберите определение понятия «риск» в соответствии с Государственным стандартом ГОСТ Р ИСО 31000-2019 «Менеджмент риска. Принципы и руководство»

- вероятность отрицательного результата
- следствие влияния неопределенности на цели
- возможная опасность
- вероятность потерь

Ответ: следствие влияния неопределенности на цели

20.2.1.2 Примеры открытых заданий:

ЗАДАНИЕ 1.

Вероятностный прогноз годовой прибыли по проекту (П) имеет следующий вид:

П, млн руб.	20	25	30
Вероятность	0,2	0,6	0,2

Рассчитать величину математического ожидания годовой прибыли и риск недостижения прибылью этого уровня (коэффициент вариации), если среднеквадратическое отклонение равно 7,07.

Решение

$$20 \cdot 0,2 + 25 \cdot 0,6 + 30 \cdot 0,2 = 4 + 15 + 6 = 25$$

$$\text{Среднеквадратическое отклонение} = 7,07$$

$$K\text{-т вариации} = 7,07 / 25 = 0,2828$$

Ответ: 0,2828

## ЗАДАНИЕ 2.

Целью предприятия является получение годовой прибыли в размере 10 млн руб. Управляющие разработали три сценария развития предприятия: пессимистичный, наиболее реальный и оптимистичный. Если события с вероятностью 30 % будут развиваться по пессимистичному сценарию, то годовая прибыль предприятия составит 5 млн руб. Если события с вероятностью 50 % будут развиваться по наиболее реальному сценарию, то годовая прибыль предприятия составит 10 млн руб. Оптимистичный сценарий в случае его реализации с вероятностью 20 % принесет годовую прибыль в размере 15 млн руб. Предприятие в процессе осуществления своей финансово-хозяйственной деятельности не привлекает заемные средства. Определить максимально возможное колебание прибыли от его среднеожидаемого значения, то есть среднеквадратичное отклонение.

Решение:

Составим вероятностный прогноз годовой прибыли (П) предприятия

Математическое ожидание годовой прибыли составит

$$\bar{П} = 5 \cdot 0,3 + 10 \cdot 0,5 + 15 \cdot 0,2 = 1,5 + 5 + 3 = 9,5 \text{ млн руб.}$$

Среднеквадратичное отклонение будет равно

$$\sigma_{П} = \sqrt{(5-9,5)^2 \cdot 0,3 + (10-9,5)^2 \cdot 0,5 + (15-9,5)^2 \cdot 0,2} = \sqrt{12,25} = 3,5 \text{ млн руб.}$$

Ответ: 3,5 млн. руб.

## ЗАДАНИЕ 3.

С помощью этого метода все возможные решения проекта отображаются графически?

Ответ: дерево решений

## ЗАДАНИЕ 4.

Какому термину соответствует следующее определение? \_\_\_\_\_

это разнообразные способы описания распределения рисков объекта по важным для этого объекта пространственным, технологическим, организационным и прочим структурам

Ответ: Карта рисков

## ЗАДАНИЕ 5. Какому термину соответствует следующее определение?

— процесс определения рисков, которые могут повлиять на проект, и документирование их характеристик.

Ответ : Идентификация рисков

ЗАДАНИЕ 6. Сущность данного метода оценки риска состоит в том, что при анализе степени риска определенного направления предпринимательской деятельности целесообразно использовать данные о развитии таких же и аналогичных направлений в прошлом.

Ответ: Метод использований аналогий

ЗАДАНИЕ 7. Как называется метод исследования и идентификации возможных сценариев развития событий путем представления или экстраполяции известных опасных событий и риска в предположении, что каждый из этих сценариев может произойти?

Ответ: Анализ сценариев

**ЗАДАНИЕ 8.** Как называется метод получения экспертных оценок, которые могут помочь при идентификации источников и воздействий опасности, количественной оценке вероятности и последствий и общей оценке риска? Это метод обобщения мнений экспертов. Метод позволяет провести независимый анализ и голосование экспертов.

Ответ: Метод Дельфи

#### ЗАДАНИЕ 9.

Фермер может выращивать либо кукурузу, либо соевые бобы. Вероятность того, что цены на будущий урожай этих культур повысится, останутся на том же уровне или понизятся, равна соответственно 0,25, 0,30 и 0,45. Если цены возрастут, урожай кукурузы даст 30000 долл. чистого дохода, а урожай соевых бобов 10000 долл. Если цены останутся неизменными, фермер лишь покроет расходы. Но если цены станут ниже, урожай кукурузы и соевых бобов приведет к потерям в 35000 и 5000 долл. соответственно. Представьте данную задачу в виде дерева решений. Какую культуру следует выращивать?

Решение

$$EMV(\text{кукуруза}) = 30000 \cdot 0,25 + 0 - 35000 \cdot 0,45 = -8250$$

$$EMV(\text{бобы}) = 10000 \cdot 0,25 + 0 + 5000 \cdot 0,45 = 250$$

Ответ: бобы

**ЗАДАНИЕ 10.** К какому методу управления рисками относится следующий пример: прекращение производства определенной продукции, отказ от сферы бизнеса?

Ответ: отказ от риска

#### 20.2.2 Требования к выполнению заданий, шкалы и критерии оценивания

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

Промежуточная аттестация по дисциплине осуществляется в форме зачета.

Контрольно-измерительные материалы зачета с оценкой включают в себя 10 закрытых (тестовых заданий) и 10 открытых заданий. Примеры заданий приведены в разделах 20.2.1.1 и 20.2.1.2. Решение указанных заданий оценивается по следующей шкале:

Количество правильно выполненных заданий (в %)	Оценка
100–60	зачет
59– 0	Не зачет

Зачет может быть выставлен по результатам текущей аттестации обучающегося (индивидуального задания) при отсутствии пропущенных занятий.

Соотношение показателей, критериев и шкалы оценивания результатов обучения.

Критерии оценивания компетенций	Шкала оценок
Обучающийся демонстрирует знание и владение теоретическими и методическими основами оценивания рисков и применения методов управления рисками и умеет: - выявлять и оценивать риски, возникающие в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений деятельности организаций и их структурных подразделений; - выбирать методы и разрабатывать мероприятия по управлению рисками; - проводить мониторинг рисков, учитывать новые обстоятельства, изменяющие уровень риска; - логически излагать материал, делать выводы и обобщения.	зачтено
Обучающийся демонстрирует поверхностные знания основных терминов, показателей, используемых в дисциплине и не способен: - выявлять и оценивать риски, возникающие в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений деятельности организаций и их структурных подразделений; - выбирать методы и разрабатывать мероприятия по управлению рисками;	незачтено

<ul style="list-style-type: none"> <li>- проводить мониторинг рисков, учитывать новые обстоятельства, изменяющие уровень риска ;</li> <li>- логически излагать материал, делать выводы и обобщения.</li> </ul>	
--	--

Задания разделов 20.2.1.1 и 20.2.1.2 рекомендуются к использованию при проведении диагностических работ с целью с целью оценки остаточных знаний по результатам освоения данной дисциплины.