

**МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего профессионального образования
Воронежский государственный архитектурно-строительный университет

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по научной работе
В.Я. Мищенко

«1» октября 2015 г.



**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА
Дисциплины**

«Анализ и управление рисками в экономических системах»

Направление подготовки аспиранта: 38.06.01 Экономика

Направленность: 08.00.13 Математические и инструментальные методы экономики

Квалификация (степень) выпускника Исследователь. Преподаватель-исследователь

Нормативный срок обучения 3 года

Форма обучения очная

Автор рабочей программы _____ д.э.н., проф. Э.Ю. Околелова

Программа обсуждена на заседании кафедры
«Экономики и основ предпринимательства»

«21» августа 2015 года Протокол № 1
Зав. кафедрой, д.э.н., профессор _____ /Гасилов В.В./

Воронеж 2015

ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Цели дисциплины: Цель изучения дисциплины «Анализ и управление рисками в экономических системах» - освоение методов систематизации и обобщения информации о рисках деятельности организации; выработка навыков использования количественных и качественных методов идентификации и анализа рисков.

1.2. Задачи освоения дисциплины: В ходе изучения дисциплины студент должен решать такие задачи как обоснование природы неопределенности и риска, идентификация и классификация рисков, качественная и количественная оценка рисков, выбор метода управления рисками.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина «Анализ и управление рисками в экономических системах», индекс Б1.В.ДВ.3 относится к дисциплинам по выбору вариативной части профессионального цикла учебного плана.

3. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

В процессе освоения данной дисциплины студент формирует и демонстрирует следующие компетенции:

Способность к критическому анализу и оценке современных научных достижений, генерирование новых идей при решении исследовательских и практических задач, в том числе в междисциплинарных областях (УК-1);

Способность самостоятельно осуществлять научно-исследовательскую деятельность в соответствующей профессиональной области с использованием современных методов исследования и информационно-коммуникационных технологий (ОПК-1);

Способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей (ПК-1);

Способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом (ПК-2).

Способность представлять результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи или доклада (ПК-4)

Способность к развитию математического аппарата экономических исследований, методов его применения и встраивания в инструментальные средства для повышения обоснованности управленческих решений на всех уровнях экономики (ПК-6)

Способность разрабатывать и исследовать модели и математические методы анализа отраслей народного хозяйства, фирм и предприятий, домашних хозяйств, рынков, механизмов формирования спроса и потребления, способов

количественной оценки предпринимательских рисков и обоснования инвестиционных решений (ПК-7)

Способность к разработке и развитию математических моделей и методов управления различными видами рисков (ПК-8)

В результате освоения дисциплины студент должен:

Знать:

- виды особенности рисков в экономической деятельности;
- механизмы воздействия на риски;
- способы принятия решений в условиях риска и неопределенности.

Уметь:

- выделять, идентифицировать и распознавать основные виды рисков;
- производить оптимизацию и оценку рисков;
- принимать эффективные решения по управлению рисками.

Владеть:

- методологией идентификации рисков, адаптивного динамического демпфирования рисков, оптимизации и оценки рисков.

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Анализ и управление рисками в экономических системах» составляет 3 зачетных единицы, 108 часов .

Вид учебной работы	Всего часов	Семестры
		4
Аудиторные занятия (всего)	32	32
В том числе:		
Лекции	8	8
Практические занятия (ПЗ)	24	24
Лабораторные работы (ЛР)	-	-
Самостоятельная работа (всего)	76	76
В том числе:		
Курсовой проект		
Контрольная работа		
Вид промежуточной аттестации (зачет, экзамен)	зачет	зачет
Общая трудоемкость час зач. ед.	108	108
	3	3

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1. Содержание разделов дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела
1	Объект, цели и задачи дисциплины «Анализ и управление рисками в экономических системах».	Объект анализа рисков как научной дисциплины, цели и задачи. Актуальные направления развития управления рисками.
2	Категория риска в науке и практике менеджмента.	Подходы к определению понятия «риск» в экономике и в управлении организацией. Событие риска, последствия риска. Условия риска как объективные условия функционирования и развития организации. Риск, как следствие внешнего воздействия на организацию. Концепция конфликта целей в организации.
3	Факторы и источники риска.	Взаимосвязь факторов и источников риска. Классификация факторов риска: фоновые, косвенного воздействия, прямого воздействия, внутриорганизационные факторы риска. Взаимосвязь факторов риска. Структурные и процессные факторы риска, их взаимосвязь. Основные проблемы идентификации и оценки влияния процессуальных факторов риска на эффективность управления. Динамика факторов риска как показатель кризисного состояния процессов.
4	Классификация рисков.	Принципы и признаки классификации рисков. Морфологическая классификация видов рисков в предпринимательстве. Структурные и процессные риски в управлении. Использование классификации рисков в разработке управленческих решений.
5	Роль неопределенности в формировании риска.	Объективная природа неопределенности в управлении организацией. Роль неопределенности в развитии организации и формировании риска. Понятие гомеостатического диапазона. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска. Взаимосвязь и закономерности формирования неопределенности и риска при разработке управленческих решений.
6	Взаимосвязь риска и	Цели управления рисками. Существенные при-

	эффективности управления.	знаки рисков и их влияние на эффективность управления: частота реализации, масштаб последствий от реализации, однородность рисков. Чистые риски и спекулятивные риски. Стратегические, тактические и операционные риски, взаимосвязь планирования рисков и планирования развития организации.
7	Подходы к оценке рисков.	Значение принципов оценки рисков. Методологические принципы оценки рисков: однотипность, позитивность, объективность, корректность, комплексность, взаимозависимость. Методические принципы: диссонансируемость, разновосприимчивость, динамичность, согласованность. Операционные принципы: моделируемость, симплифицируемость.
8	Методы анализа рисков.	Количественные и качественные методы оценки риска, условия их использования и комбинирования. Моделирование в управлении рисками.

5.2 Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами

№ п/п	Наименование последующих дисциплин	№ № тем данной дисциплины, необходимых для изучения последующих дисциплин
1.	Эконометрика	3, 4, 6, 7
2.	Экономико-математическое моделирование	2, 3, 6, 7, 8

5.3. Разделы дисциплин и виды занятий

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Лекц.	Практ. зан.	Лаб. зан.	СРС	Всего час.
1	Объект, цели и задачи дисциплины «Анализ и управление рисками в экономических системах»	1	2		8	11
2	Категория риска в науке и практике менеджмента	1	2		12	15
3.	Факторы и источники риска	1	4		8	13

4.	Классификация рисков	1	4		14	19
5.	Роль неопределенности в формировании риска	1	4		12	17
6	Взаимосвязь риска и эффективности управления	1	4		12	17
7	Подходы к оценке рисков.	1	2	-	4	7
8	Методы анализа рисков	1	2	-	6	9

5.4. Практические занятия

№ п/п	№ раздела дисциплины	Тематика практических занятий	Трудоемкость (час)
1.	1	Объект анализа рисков как научной дисциплины, цели и задачи. Актуальные направления развития управления рисками.	2
2.	2	Подходы к определению понятия «риск» в экономике и в управлении организацией. Событие риска, последствия риска. Условия риска как объективные условия функционирования и развития организации. Риск, как следствие внешнего воздействия на организацию. Концепция конфликта целей в организации.	2
3.	3	Взаимосвязь факторов и источников риска. Классификация факторов риска: фоновые, косвенного воздействия, прямого воздействия, внутри-организационные факторы риска. Основные проблемы идентификации и оценки влияния процессуальных факторов риска на эффективность управления. Динамика факторов риска как показатель кризисного состояния процессов. Решение задач.	4
4.	4	Классификация рисков. Принципы и признаки классификации рисков. Структурные и процессные риски в	4

		управлении. Использование классификации рисков в разработке управленческих решений. Решение задач.	
5.	5	Роль неопределенности в формировании риска. Понятие гомеостатического диапазона. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска. Взаимосвязь и закономерности формирования неопределенности и риска при разработке управленческих решений. Решение задач.	4
6.	6	Взаимосвязь риска и эффективности управления. Цели управления рисками. Существенные признаки рисков и их влияние на эффективность управления: частота реализации, масштаб последствий от реализации, однородность рисков. Чистые риски и спекулятивные риски. Стратегические, тактические и операционные риски, взаимосвязь планирования рисков и планирования развития организации. Решение задач.	4
7.	7	Подходы к оценке рисков. Методологические принципы оценки рисков: однотипность, позитивность, объективность, корректность, комплексность, взаимозависимость. Методические принципы: диссонансируемость, разновоспринимаемость, динамичность, согласованность. Операционные принципы: моделируемость, симплифицируемость. Решение задач.	2
8.	8	Количественные и качественные методы оценки риска, условия их использования и комбинирования. Моделирование в управлении рисками. Решение задач.	2

6. ПРИМЕРНАЯ ТЕМАТИКА КУРСОВЫХ ПРОЕКТОВ, КУРСОВЫХ И КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ

Курсовые проекты и контрольные работы не предусмотрены учебным планом

7. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО И ПРОМЕЖУТОЧНОГО КОНТРОЛЯ ЗНАНИЙ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

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

№ п/п	Компетенция (общекультурная – ОК; профессиональная – ПК)	Форма контроля	Семестр
1	УК-1 Способность к критическому анализу и оценке современных научных достижений, генерирование новых идей при решении исследовательских и практических задач, в том числе в междисциплинарных областях	Тестирование Зачет	4
2	ОПК-1 Способность самостоятельно осуществлять научно-исследовательскую деятельность в соответствующей профессиональной области с использованием современных методов исследования и информационно-коммуникационных технологий	Тестирование Зачет	4
3	ПК-1 Способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей	Тестирование Зачет	4
4	ПК-2 Способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом	Тестирование Зачет	4

5	ПК-4 Способность представлять результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи или доклада	Тестирование Зачет	4
6	ПК-6 Способность к развитию математического аппарата экономических исследований, методов его применения и встраивания в инструментальные средства для повышения обоснованности управленческих решений на всех уровнях экономики	Тестирование Зачет	4
7	ПК-7 Способность разрабатывать и исследовать модели и математические методы анализа отраслей народного хозяйства, фирм и предприятий, домашних хозяйств, рынков, механизмов формирования спроса и потребления, способов количественной оценки предпринимательских рисков и обоснования инвестиционных решений	Тестирование Зачет	4
8	ПК-8 Способность к разработке и развитию математических моделей и методов управления различными видами рисков	Тестирование Зачет	4

7.2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Дескриптор компетенции	Показатель оценивания	Форма контроля	
		Тест	Зачет
Знает	Виды особенности рисков в экономической деятельности; Механизмы воздействия на риски; Способы принятия решений в условиях риска и неопределенности (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4;	+	+

	ПК-6; ПК-7; ПК-8)		
Умеет	Выделять, идентифицировать и распознавать основные виды рисков; Производить оптимизацию и оценку рисков; Принимать эффективные решения по управлению рисками (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8)	+	+
Владеет	Методологией идентификации рисков, адаптивного динамического демпфирования рисков, оптимизации и оценки рисков (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8)	+	

7.2.1.Этап текущего контроля знаний

Результаты текущего контроля знаний и межсессионной аттестации оцениваются по пятибалльной шкале с оценками:

- «отлично»;
- «хорошо»;
- «удовлетворительно»;
- «неудовлетворительно»;
- «не аттестован».

Дескриптор компетенции	Показатель оценивания	Оценка	Критерий оценивания
Знает	Виды особенности рисков в экономической деятельности; Механизмы воздействия на риски; Способы принятия решений в условиях риска и неопределенности (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).	отлично	Полное или частичное посещение лекционных и практических занятий. Выполнение тестирования и решение задач
Умеет	Выделять, идентифицировать и распознавать основные виды рисков; Производить оптимизацию и оценку рисков;		

Дескриптор компетенции	Показатель оценивания	Оценка	Критерий оценивания
	Принимать эффективные решения по управлению рисками (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		на оценки «отлично».
Владеет	Методологией идентификации рисков, адаптивного динамического демпфирования рисков, оптимизации и оценки рисков (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		
Знает	Виды особенности рисков в экономической деятельности; Механизмы воздействия на риски; Способы принятия решений в условиях риска и неопределенности (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).	хорошо	Полное или частичное посещение лекционных и практических занятий. Выполнение тестирования и решение задач на оценки «хорошо».
Умеет	Выделять, идентифицировать и распознавать основные виды рисков; Производить оптимизацию и оценку рисков; Принимать эффективные решения по управлению рисками (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		
Владеет	Методологией идентификации рисков, адаптивного динамического демпфирования рисков, оптимизации и оценки рисков (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		
Знает	Виды особенности рисков в экономической деятельности; Механизмы воздействия на риски; Способы принятия решений в условиях риска и неопределенности (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).	удовлетворительно	Полное или частичное посещение лекционных и практических занятий. Удовлетворительное выполнение тестирования и
Умеет	Выделять, идентифицировать и распознавать основные виды рисков; Производить оптимизацию и оценку рисков; Принимать эффективные решения по управлению рисками (УК-1; ОПК-1;		

Дескриптор компетенции	Показатель оценивания	Оценка	Критерий оценивания
	ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		решение задач.
Владеет	Методологией идентификации рисков, адаптивного динамического демпфирования рисков, оптимизации и оценки рисков (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		
Знает	Виды особенности рисков в экономической деятельности; Механизмы воздействия на риски; Способы принятия решений в условиях риска и неопределенности (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).	неудовлетворительно	Частичное посещение лекционных и практических занятий. Неудовлетворительно выполнение тестирования и решение задач.
Умеет	Выделять, идентифицировать и распознавать основные виды рисков; Производить оптимизацию и оценку рисков; Принимать эффективные решения по управлению рисками (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		
Владеет	Методологией идентификации рисков, адаптивного динамического демпфирования рисков, оптимизации и оценки рисков (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		
Знает	Виды особенности рисков в экономической деятельности; Механизмы воздействия на риски; Способы принятия решений в условиях риска и неопределенности (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).	не аттестован	Непосещение лекционных и практических занятий. Не выполнено тестирование, не решены задачи.
Умеет	Выделять, идентифицировать и распознавать основные виды рисков; Производить оптимизацию и оценку рисков; Принимать эффективные решения по управлению рисками (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		
Владеет	Методологией идентификации рисков,		

Дескриптор компетенции	Показатель оценивания	Оценка	Критерий оценивания
	адаптивного динамического демпфирования рисков, оптимизации и оценки рисков (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		

7.2.2. Этап промежуточного контроля знаний

В четвертом семестре результаты промежуточного контроля знаний (зачет) оцениваются по двухбалльной шкале с оценками:

- «зачтено»;
- «не зачтено».

Дескриптор компетенции	Показатель оценивания	Оценка	Критерий оценивания
Знает	Виды особенности рисков в экономической деятельности; Механизмы воздействия на риски; Способы принятия решений в условиях риска и неопределенности (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).	зачтено	1. Аспирант демонстрирует полное понимание заданий. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены.
Умеет	Выделять, идентифицировать и распознавать основные виды рисков; Производить оптимизацию и оценку рисков; Принимать эффективные решения по управлению рисками (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		2. Аспирант демонстрирует значительное понимание заданий. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены.
Владеет	Методологией идентификации рисков, адаптивного динамического демпфирования рисков, оптимизации и оценки рисков (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		3. Аспирант демонстрирует частичное понимание заданий. Большинство требований, предъявляемых к заданию, выполнены.

Дескриптор компетенции	Показатель оценивания	Оценка	Критерий оценивания
Знает	Виды особенности рисков в экономической деятельности; Механизмы воздействия на риски; Способы принятия решений в условиях риска и неопределенности (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).	не зачтено	1. Аспирант демонстрирует небольшое понимание заданий. Многие требования, предъявляемые к заданию, не выполнены.
Умеет	Выделять, идентифицировать и распознавать основные виды рисков; Производить оптимизацию и оценку рисков; Принимать эффективные решения по управлению рисками (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		2. Аспирант демонстрирует непонимание заданий. 3. У аспиранта нет ответа. Не было попытки выполнить задание.
Владеет	Методологией идентификации рисков, адаптивного динамического демпфирования рисков, оптимизации и оценки рисков (УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8).		

7.3. Примерный перечень оценочных средств (типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности)

7.3.1. Примерная тематика РГР

Не предусмотрено учебным планом

7.3.2. Примерная тематика и содержание КР

Не предусмотрено учебным планом

7.3.3. Примерный перечень вопросов для коллоквиумов

Не предусмотрено учебным планом

7.3.4. Примерные задания для тестирования

1) Выявление рисков – аспект анализа рисков:

- А) Количественный;
 - Б) Качественный;
 - В) Статистический;
 - Г) Экономический;
 - Д) Математический;
 - Е) Субъективный.
- 2) Первым этапом идентификации рисков является:
- А) Сбор информации;
 - Б) Комплексный анализ рисков;
 - В) Осмысление рисков;
 - Г) Анализ причин возникновения рисковых ситуаций;
 - Д) Составление функциональной зависимости;
 - Е) Установление взаимосвязей между рисками.
- 3) К основным методам выявления рисков относят:
- А) Осмысление риска;
 - Б) Опросный лист;
 - В) Поточные диаграммы;
 - Г) Инспекции;
 - Д) Комплексный анализ рисков;
 - Е) Организационные схемы.
- 4) Опросный лист – это:
- А) Метод получения информации для целей выявления рисков;
 - Б) Метод получения информации для оценки рисков;
 - В) Графический метод получения информации;
 - Г) Совокупность вопросов, описывающих объект изучения;
 - Д) Метод получения информации для целей оценки рисков;
 - Е) Формализованный метод получения информации.
- 5) Структурные диаграммы позволяют определить следующие формы внутреннего риска:
- А) Дублирование;
 - Б) Взаимозависимость;
 - В) Концентрация;
 - Г) Централизация;
 - Д) Зависимость;
 - Е) Координирование.
- 6) Карты потоков – это:
- А) Графический метод получения информации об отдельных технологических процессах;
 - Б) Один из методов получения информации для целей выявления рисков;
 - В) Разновидность структурных диаграмм;
 - Г) Один из методов измерения рисков;
 - Д) Один из методов получения информации для целей оценки рисков;
 - Е) Формализованный метод получения информации об отдельных технологических процессах.
- 7) Поточные диаграммы позволяют определить:

- А) Критические области производственного процесса;
 - Б) Особенности технологии производства продукции;
 - В) Масштабы потерь при том или ином инциденте;
 - Г) Характеристику и состояние особо опасных агрегатов;
 - Д) Возможные альтернативы развития производственного процесса;
 - Е) Подробности недавних происшествий.
- 8) Основные недостатки прямой инспекции:
- А) Отсутствие стимула для выявления рисков;
 - Б) Большие временные затраты;
 - В) Уменьшение ответственности и внимания управленческого персонала;
 - Г) Отсутствие возможности предусмотреть все возможные риски и их последствия;
 - Д) Отсутствие возможности выявления «узких мест»;
 - Е) Отсутствие возможности сравнения собственной оценки происходящего с мнениями экспертов.
- 9) Назовите основные варианты инспекций:
- А) Структурные инспекции;
 - Б) Поточковые инспекции;
 - В) Неожиданные инспекции;
 - Г) Статистические инспекции;
 - Д) Управленческие инспекции;
 - Е) Инспекции заблаговременного извещения.
- 10) Схемы принятия решений в изучаемом хозяйствующем субъекте относятся к:
- А) Основным методам идентификации рисков;
 - Б) Статистическим методам идентификации рисков;
 - В) Финансовым методам идентификации рисков;
 - Г) Управленческим методам идентификации рисков;
 - Д) Дополнительным методам идентификации рисков;
 - Е) Вспомогательным методам идентификации рисков.

7.3.5 Вопросы для подготовки к зачету

1. Риск: сущность риска, событие риска, последствия риска.
2. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
3. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.
4. Концепция конфликта целей в организации.
5. Неопределенность, ее роль в развитии организации.
6. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.
7. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска.
8. Существенные признаки рисков. Влияние риска на эффективность управления.
9. Экономическая автономность, рискозащищенность. Модели экономической рискозащищенности.

10. Классификация факторов риска по степени непосредственного воздействия на эффективность управления.
11. Структурные и процессуальные факторы риска: проблемы идентификации и оценки.
12. Динамика факторов риска как показатель кризисного развития процессов.
13. Использование теории жизненного цикла организации при анализе и планировании рисков.
14. Подходы к управлению рисками: интенсивный, экстенсивный.
15. Типология субъектов управленческих решений по степени склонности к риску. Субъективная оценка вероятности риска и ожидаемых потерь.
16. Принцип приемлемого риска.
17. Классификации рисков в управлении: признаки классификации, принципы использования.
18. Взаимосвязь структурных и процессных рисков в управлении организацией.
19. Методологические принципы оценки рисков.
20. Методические и операционные принципы оценки рисков.
21. Количественные методы оценки рисков.
22. Качественные методы оценки рисков.
23. Использование моделирования в управлении рисками.
24. Определение величины потерь от реализации риска по наличным денежным средствам и ценным бумагам.
25. Определение величины потерь от реализации риска по недвижимому имуществу.
26. Определение величины потерь от реализации риска по машинам, оборудованию и транспортным средствам.
27. Определение величины от реализации риска потерь по запасам.
28. Определение величины потерь от реализации риска по нематериальным активам.
29. Анализ рисков как этап разработки программы управления рисками.
30. Использование технических инноваций для повышения эффективности управления рисками.
31. Особенности оценки рисков в финансовой и инвестиционной сферах деятельности организации.
32. Риск в управлении прямыми и портфельными инвестициями.
33. Распределение рисков между участниками проекта.
34. Классификация рисков производственной деятельности.
35. Особенности управления рисками взаимодействия с контрагентами в производственной деятельности организации.
36. Роль системы обеспечения безопасности производства в снижении рисков.

7.3.6 Вопросы для подготовки к экзамену

Не предусмотрены учебным планом

7.3.7. Паспорт фонда оценочных средств

№ п/п	Контролируемые раз- делы (темы) дисцип- лины	Код контроли- руемой компе- тенции (или ее части)	Наименование оце- ночного средства
1	Объект, цели и задачи дисциплины «Анализ и управление рисками в экономических системах»	УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8	Тестирование (Т) Зачет
2	Категория риска в нау- ке и практике менедж- мента	УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8	Тестирование (Т) Зачет
3	Факторы и источники риска	УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8	Тестирование (Т) Зачет
4	Классификация рисков	УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8	Тестирование (Т) Зачет
5	Роль неопределенности в формировании риска	УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8	Тестирование (Т) Зачет
6	Взаимосвязь риска и эффективности управ- ления	УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8	Тестирование (Т) Зачет
7	Подходы к оценке рис- ков.	УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8	Тестирование (Т) Зачет
8	Методы анализа рис- ков	УК-1; ОПК-1; ПК-1; ПК-2; ПК-4; ПК-6; ПК-7; ПК-8	Тестирование (Т) Зачет

7.4. Порядок процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности на этапе промежуточного контроля знаний

Зачет может проводиться по итогам текущей успеваемости и сдачи курсовой работы и (или) путем организации специального опроса, проводимого в устной и (или) письменной форме.

Во время проведения экзамена (зачета) обучающиеся могут пользоваться программой дисциплины, а также вычислительной техникой.

8. ПЕРЕЧЕНЬ УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИ- ПЛИНЕ (МОДУЛЮ), РАЗРАБОТАННОГО НА КАФЕДРЕ

№ п/п	Наименование изда- ния	Вид издания (учебник, учеб- ное пособие, методические указания, ком- пьютерная программа)	Автор (ав- торы)	Год из- дания	Место хра- нения и ко- личество
1	Управление рисками	Учебное посо- бие	Баркалов, С.А.	2012	Библиотека – 21 экз

9. МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Вид учебных занятий	Деятельность студента
Лекция	Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последо- вательно фиксировать основные положения, выводы, форму- лировки, обобщения; пометать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписы- ванием толкований в тетрадь. Обозначение вопросов, терми- нов, материала, которые вызывают трудности, поиск ответов в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удает- ся разобраться в материале, необходимо сформулировать во- прос и задать преподавателю на консультации, на практиче- ском занятии.
Практические занятия	Конспектирование рекомендуемых источников. Работа с кон- спектом лекций, подготовка ответов к контрольным вопро- сам, просмотр рекомендуемой литературы. Прослушивание аудио- и видеозаписей по заданной теме, выполнение расчет- но-графических заданий, решение задач по алгоритму.
Подготовка к экзамену (заче- ту)	При подготовке к экзамену (зачету) необходимо ориентиро- ваться на конспекты лекций, рекомендуемую литературу и решение задач на практических занятиях.

10. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

10.1 Основная литература:

1. Антикризисное управление: механизмы государства, технологии бизнеса [Текст] : учебник и практикум для академического бакалавриата : рекомендовано Учебно-методическим отделом / Моск. гос. ун-т им. М. В. Ломоносова ; под общ. ред. А. З. Бобылевой. - Москва : Юрайт, 2015 (Чехов : ОАО "Первая Образцовая тип.", фил. "Чеховский Печатный Двор", 2015). - 639 с.
2. Баркалов, С.А. Управление рисками [Текст] : учеб.-метод. комплекс / Баркалов, Сергей Алексеевич, Киреева, Екатерина Александровна, Семенов, Петр Иванович. - Воронеж : Научная книга, 2012 (Воронеж : ООО "Цифровая полиграфия", 2012). - 479 с.
3. Чернова, Г. В. Управление рисками [Электронный ресурс] : электрон. учебник : допущено МО РФ / Г. В. Чернова, А. А. Кудрявцев. - М. : Кнорус, 2009. - 1 электрон. опт. диск : зв., цв.

10.2 Дополнительная литература:

1. Алексеенко В.Б. Математические модели в экономике [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Алексеенко В.Б., Коршунов Ю.С., Красавина В.А.— Электрон. текстовые данные.— М.: Российский университет дружбы народов, 2013.— 80 с.
2. Гетманчук А.В. Экономико-математические методы и модели [Электронный ресурс]: учебное пособие для бакалавров/ Гетманчук А.В., Ермилов М.М.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 186 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/14124>.
3. Ильченко А.Н. Практикум по экономико-математическим методам [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Ильченко А.Н., Ксенофонтова О.Л., Канакина Г.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: Финансы и статистика, 2014.— 288 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/18831>.
4. Казакова, Н. А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски [Текст] : учеб. пособие : рек. УМО / Н. А. Казакова. - М. : Инфра-М, 2011. - 207 с.
5. Федосеев В.В. Математическое моделирование в экономике и социологии труда. Методы, модели, задачи [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Федосеев В.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012.— 167 с

Нормативные документы

1. Инструкция №1. «О порядке деятельности кредитных организаций», в ред. Письма ЦБ РФ от 31.01.97 №402. (с изменениями и дополнениями).
2. Закон РФ от 27.11.92 г. № 4015-1 (ред. от 20.11.99 г.) Об Организации страхового дела в Российской Федерации (с изменениями и дополнениями).
3. Распоряжение Федеральной комиссии по рынку ценных бумаг №03-558/р от 25.03.2003г. «Об утверждении квалификационного минимума по специализированному экзамену для специалистов по корпоративным финансам».

4. Федеральный закон от 22 апреля 1996 года N 39-ФЗ "О рынке ценных бумаг" (с изменениями и дополнениями).
5. Федеральный закон от 5 марта 1999 года N 46-ФЗ "О защите прав и законных интересов инвесторов на рынке ценных бумаг" (с изменениями и дополнениями).
6. Постановление Правительства Российской Федерации от 6 июля 2001 года N519 "Об утверждении стандартов оценки" (с изменениями и дополнениями).
7. Постановление ФКЦБФР при Правительстве Российской Федерации от 7 мая 1996 года N 8 "О порядке и объеме информации, которую акционерное общество обязано публиковать в случае публичного размещения им облигаций и иных ценных бумаг" (с изменениями и дополнениями).

10.3 Программное обеспечение и Интернет-ресурсы:

1. Microsoft Excell – универсальный табличный процессор, включающий библиотеку из множества функций;
2. MS Office, Internet Explorer

11. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Лекционные и практические занятия проводятся в аудитории, оснащенной компьютером и мультимедийным оборудованием.

Практические занятия проводятся в компьютерном классе, где установлены статистические программы.

12. МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (образовательные технологии)

Получение углубленных знаний по изучаемой дисциплине достигается за счет дополнительных часов к аудиторной работе - самостоятельной работы студентов.

Самостоятельная работа занимает важное место в образовательной программе подготовки бакалавров, поэтому важно создать целостную систему организации самостоятельной работы, включающей четко сформулированные задания, разнообразные формы контроля, методические рекомендации по выполнению разных видов работ.

В ходе самостоятельной работы студент должен:

- освоить знание теоретического материала по изучаемой дисциплине;
- закрепить знания теоретического материала практическим путем;
- применить полученные знания и практические навыки для анализа ситуации и выработки правильного решения;

