

**МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ  
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение  
высшего образования  
«Воронежский государственный технический университет»



УТВЕРЖДАЮ

Декан ФЭМИТ

/Баркалов С.А.

29 июня 2018 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

по дисциплине:

«Риск-менеджмент»

Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент

Профиль (специализация) Теория управления


Квалификация выпускника магистр

Нормативный период обучения 2 года / 2 года и 4 м.

Форма обучения Очная/Заочная

Год начала подготовки 2018 г.

Автор программы



Е.А.Сидорова

Заведующий кафедрой

Управления строительством



С.А.Баркалов

Руководитель ОПОП



Я.С.Строганова

Воронеж 2018

## **1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ**

### **1.1. Цели дисциплины**

является анализ, диагностика и снижение уровня риска, предотвращение недопустимого риска; участие в разработке и реализации комплекса мероприятий операционного характера в соответствии с финансовой стратегией организации; планирование деятельности организации и подразделений.

### **1.2. Задачи освоения дисциплины**

- изучение методологических основ принятия риск-решений;
- изучение методологии адаптивного динамического управления рисками
- принципы управления различными видами рисков;
- организация управления рисками;
- контроль деятельности подразделений, команд (групп) работников;
- мотивирование и стимулирование персонала организации, направленное на достижение стратегических и оперативных целей;
- информационно-аналитическая деятельность: сбор, обработка и анализ информации о факторах внешней и внутренней среды организации для принятия управленческих решений;
- построение внутренней информационной системы организации для сбора информации с целью принятия решений, планирования деятельности и контроля;
- приобретение студентами практических знаний и навыков по обоснованию и оценке рисков и предупредительных управленческих мер;

## **2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП**

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к дисциплинам вариативной части (дисциплина по выбору) блока Б1.

## **3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Процесс изучения дисциплины «Конфликтология» направлен на формирование следующих компетенций:

ОК-1 - способностью к абстрактному мышлению, анализу, синтезу

ОК-3 - готовностью к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала

ПК-2 - способностью разрабатывать корпоративную стратегию, программы организационного развития и изменений и обеспечивать их реализацию

ПК-4 - способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения

Компетенция	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции
Компетенция ОК-1	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции
	Знать методы анализа и синтеза информации.
	Уметь абстрактно мыслить, анализировать и обобщать полученную в ходе исследования информацию.
ОК-3	Знать основы стратегического управления, функциональные стратегии организации; методы управления риском для стратегического анализа.
	Уметь определять взаимосвязи между функциональными стратегиями подготавливать; принимать сбалансированные управленческие решения в условиях риска
	Владеть навыками анализа функциональных стратегий организации навыками принятия сбалансированных управленческих решений на основе результатов анализа взаимосвязи функциональных стратегий;
ПК-2	Владеть основными приёмами управления в условиях повышенного риска, самооценки профессиональной деятельности; подходами к совершенствованию творческого потенциала
	Знать: <ul style="list-style-type: none"> <li>• современные стратегические тактические инструменты управления организацией;</li> <li>• технологию построения процессов принятия решения в условиях риска;</li> </ul>
	Уметь <ul style="list-style-type: none"> <li>• применять современные модели управления в условиях неопределенности;</li> <li>• организовывать командное взаимодействие для решения поставленных задач в условиях риска</li> </ul> применять подходы управления по ценностям, разрабатывать анализировать корпоративную культуру компании, оценивать ее потенциал
ПК-4	Владеть <ul style="list-style-type: none"> <li>• аналитическими модели и количественными и методами управления риском;</li> <li>• навыками контроля и оценки и деятельности подразделений и сотрудников.</li> </ul>
	Знать: <ul style="list-style-type: none"> <li>• Причины возникновения рисков событий и последствия</li> </ul>

	<p>возникшие в ходе их решения;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Способы разрешения и предупреждения рисков.</li> </ul>
	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• анализировать риски и применять эффективные методы их разрешения.</li> <li>• систематизировать данные, полученные в ходе научного наблюдения, формировать гипотезы;</li> <li>• адекватно оценивать поведение в рискованных ситуациях</li> </ul>

#### 4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Конфликтология» составляет 3 з.е.

Распределение трудоемкости дисциплины по видам занятий

##### очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего часов	Семестры
		3
<b>Аудиторные занятия (всего)</b>	52	52
В том числе:		
Лекции	18	18
Практические занятия (ПЗ)	34	34
<b>Самостоятельная работа</b>	56	56
<b>Курсовая работа</b>	+	+
Виды промежуточной аттестации - зачет	+	+
Общая трудоемкость:		
академические часы	108	108
зач.ед.	3	3

##### заочная форма обучения

Виды учебной работы	Всего часов	Семестры
		3
<b>Аудиторные занятия (всего)</b>	6	6
В том числе:		
Лекции	2	2
Практические занятия (ПЗ)	4	4
<b>Самостоятельная работа</b>	98	98
<b>Курсовая работа</b>	+	+
Часы на контроль	4	4
Виды промежуточной аттестации - зачет	+	+
Общая трудоемкость:		
академические часы	108	108
зач.ед.	3	3

#### 5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

5.1 Содержание разделов дисциплины и распределение трудоемкости по видам занятий

##### очная форма обучения

№	Наименование темы	Содержание раздела	Лекц	Прак	СРС	Всего,
---	-------------------	--------------------	------	------	-----	--------

п/п				зан.		час
1	Основные понятия и природа возникновения риска	Этапы модели ЖЦ предприятия; этапы жизни и динамика рисков фирмы; рискообразующие факторы; риск как основа создания дополнительной прибыли; Классификация рисков	4	4	8	16
2	Риск в бизнес-планировании и бюджетировании	Порядок разработки бизнес-плана; типичные ошибки в бизнес планировании; повышение устойчивости бизнес-планов; бюджетирование риск-менеджмента	4	6	8	18
3	Риск-менеджмент. Стратегия управления риском	Профессия риск-менеджер; методологические основы принятия риск-решений; методология адаптивного динамического управления рисками	4	6	10	20
4	Методы оценки, анализа и прогнозирования риска	Качественный; количественный; статистический; аналитический; экспертный; картографирование рисков	2	6	10	18
5	Управление рисками	Основные приемы и этапы управления риском; алгоритм управления; классификация методов управления рисками; критерий отбора и основное правило метода управления риском; основные стратегические направления снижения риска; методы минимизации хозяйственных рисков; финансовый аспект управления рисками; методы и модели управления инвестиционными рисками; страхование (хеджирование); методы анализа и снижения «природных» рисков ; рынок альтернативных методов перевода риска; современные тенденции в управлении рисками; контроль процесса управления рисками	2	6	10	18
6	Психологические аспекты управления риском	Склонность к риску Методы идентификации поведенческого риска Методы и технологии идентификации рисков неустановленной природы («природных») Модели и методы разработки решений по управлению поведенческими рисками	2	6	10	18
<b>Итого</b>			<b>18</b>	<b>34</b>	<b>56</b>	<b>108</b>

### заочная форма обучения

№ п/п	Наименование темы	Содержание раздела	Лекц	Прак зан.	СРС	Всего, час
1	Основные понятия и природа возникновения	Этапы модели ЖЦ предприятия; этапы жизни и динамика рисков фирмы; рискообразующие факторы; риск как основа	2	-	16	18

	риска	создания дополнительной прибыли; Классификация рисков				
2	Риск в бизнес-планировании и бюджетировании	Порядок разработки бизнес-плана; типичные ошибки в бизнес планировании; повышение устойчивости бизнес-планов; бюджетирование риск-менеджмента	-	-	16	16
3	Риск-менеджмент. Стратегия управления риском	Профессия риск-менеджер; методологические основы принятия риск-решений; методология адаптивного динамического управления рисками	-	-	16	16
4	Методы оценки, анализа и прогнозирования риска	Качественный; количественный; статистический; аналитический; экспертный; картографирование рисков	-	-	16	16
5	Управление рисками	Основные приемы и этапы управления риско; алгоритм управления; классификация методов управления рисками; критерий отбора и основное правило метода управления риском; основные стратегические направления снижения риска; методы минимизации хозяйственных рисков; финансовый аспект управления рисками; методы и модели управления инвестиционными рисками; страхование (хеджирование); методы анализа и снижения «природных» рисков ; рынок альтернативных методов перевода риска; современные тенденции в управлении рисками; контроль процесса управления рисками	-	2	16	18
6	Психологические аспекты управления риском	Склонность к риску  Методы идентификации поведенческого риска  Методы и технологии идентификации рисков неустановленной природы («природных»)  Модели и методы разработки решений по управлению поведенческими рисками	-	2	18	20
<b>Итого</b>			<b>2</b>	<b>4</b>	<b>98</b>	<b>104</b>

## 5.2 Перечень лабораторных работ

Не предусмотрено учебным планом

## 6. ПРИМЕРНАЯ ТЕМАТИКА КУРСОВЫХ ПРОЕКТОВ (РАБОТ) И КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ

В соответствии с учебным планом освоение дисциплины предусматривает выполнение курсовой работы в 3 семестре для очной формы обучения, в 3 семестре для заочной формы обучения.

Примерная тематика курсовой работы: « \_\_\_\_ »

- 1 Риск в экономической и предпринимательской деятельности.
- 2 Анализ рисков организации. Источники информации о рисках.
- 3 Методы идентификации рисков. Картографирование рисков организации.
- 4 Методы оценки рисков. Статистические методы оценки рисков: сравнительный анализ и условия применения.
- 5 Методы оценки рисков. Аналитические методы оценки рисков. Развитие аналитических методов оценки рисков в практике риск-менеджмента.
- 6 Экспертные методы оценки рисков. Получение индивидуальных и коллективных экспертных оценок: достоинства и недостатки применяемых методов.
- 7 Предпринимательские риски: сущность, понятие, методы оценки и управления.
- 8 Методы управления финансовыми рисками. Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков организации. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков.
- 9 Кредитные риски. Роль доллара в современных международных валютных и кредитных отношениях.
- 10 Валютные риски. Мировой валютный рынок: современное состояние и перспективы развития. Мировая долларизация и ее место в глобализации.
- 11 Процентные риски. Влияние учетной ставки процента на экономическую активность. Процентные риски в системе банковских рисков.
- 12 Операционные риски: идентификация и оценка. Выбор критерия управления операционными рисками.
- 13 Рыночные риски. Методы оценки и инструменты регулирования.
- 14 Риски ликвидности. Анализ денежных потоков организации как метод управления рисками ликвидности. Пути повышения ликвидности и платежеспособности организации.
- 15 Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация. Поиск наиболее эффективного пути развития.
- 16 Инвестиционные риски. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта.
- 17 Инвестиционные риски. Формирование инвестиционного портфеля с учетом риска.
- 18 Стратегические риски. Стратегическая безопасность. Проблемы и перспективы глобализации.
- 19 Страновые риски. Мировой экономический кризис и тенденции развития российской экономики.
- 20 Политические риски.
- 21 Техногенные риски.
- 22 Принятие решений в условиях неопределенности и риска.
- 23 Организация системы риск-менеджмента предприятия.
- 24 Основы банковского риск-менеджмента.
- 25 Риск-менеджмент в страховом деле.
- 26 Методы управления риском. Общая схема процесса управления риском.

Выбор методов управления риском на основе оценки их сравнительной эффективности.

27 Методы управления риском: хеджирование.

28 Методы управления риском: лимитирование.

29 Методы управления риском: страхование самострахование.

30 Методы управления риском: диверсификация. Анализ существующих подходов к размещению капитала по направлениям деятельности.

31 Диагностика финансового кризиса предприятия. Анализ рисков при угрозе банкротства.

32 Методы нейтрализации рисков. Рынок форвардов в России. Хеджирование на основе инструментов FORTS.

33 Риски в глобальной экономике: основные подходы к управлению.

34 Риски мировой валютной системы. Перспективы кризиса.

35 Использование рискостоймости (VAR) для анализа рисков

36 Использование метода статистических испытаний (Monte-Carlo Simulation) в системе управления рисками

## **7. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

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

### **7.1.1 Этап текущего контроля**

Результаты текущего контроля знаний и межсессионной аттестации оцениваются по следующей системе:

«аттестован»;

«не аттестован».

<b>Компетенция</b>	<b>Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции</b>	<b>Критерии оценивания</b>	<b>Аттестован</b>	<b>Не аттестован</b>
ОК-1	Знать методы анализа и синтеза информации.	Опросы по лекционному материалу; демонстрация теоретических знаний при выполнении практических заданий	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь абстрактно мыслить, анализировать и обобщать полученную в ходе исследования информацию.		Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Знать основы стратегического управления, функциональные стратегии организации; методы управления риском		Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах



	для стратегического анализа.			
ОК-3	Уметь определять взаимосвязи между функциональными стратегиями подготавливать; принимать сбалансированные управленческие решения в условиях риска	Опросы по лекционному материалу; демонстрация теоретических знаний при выполнении практических заданий	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть навыками анализа функциональных стратегий организации навыками принятия сбалансированных управленческих решений на основе результатов анализа взаимосвязи функциональных стратегий;		Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть основными приемами управления в условиях повышенного риска, самооценки профессиональной деятельности; подходами к совершенствованию творческого потенциала		Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
ПК-2	Знать: <ul style="list-style-type: none"> <li>• современные стратегические тактические инструменты управления организацией;</li> <li>• технологию построения процессов принятия решения в условиях риска;</li> </ul>	Опросы по лекционному материалу; демонстрация теоретических знаний при выполнении практических заданий	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь <ul style="list-style-type: none"> <li>• применять современные</li> </ul>		Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах

	<p>модели управления в условиях неопределенности ;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• организовывать командное взаимодействие для решения поставленных задач в условиях риска</li> <li>• применять подходы управления по ценностям, разрабатывать анализировать корпоративную культуру компании, оценивать ее потенциал</li> </ul>			<p>программах</p>
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• аналитическими модели и количественными и методами управления риском;</li> <li>• навыками контроля и оценки и деятельности подразделений и сотрудников.</li> </ul>		<p>Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах</p>	<p>Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах</p>
<p>ПК-4</p>	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Причины возникновения рисков событий и последствия возникшие в ходе их решения;</li> <li>• Способы разрешения и предупреждения рисков.</li> </ul>	<p>Опросы по лекционному материалу; демонстрация теоретических знаний при выполнении практических заданий</p>	<p>Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах</p>	<p>Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах</p>
	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• анализировать риски и применять эффективные</li> </ul>		<p>Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах</p>	<p>Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах</p>

	методы их разрешения. <ul style="list-style-type: none"> <li>• систематизировать данные, полученные в ходе научного наблюдения, формировать гипотезы;</li> <li>• адекватно оценивать поведение рисков в ситуациях</li> </ul>		
	Владеть: <ul style="list-style-type: none"> <li>• конструктивно действовать в ситуациях неопределенности ;</li> <li>• основами предупреждения и разрешения рисков в ситуациях</li> </ul>	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах

### 7.1.2 Этап промежуточного контроля знаний

Результаты промежуточного контроля знаний оцениваются в 3 семестре для очной формы обучения, 3 семестре для заочной формы обучения по двухбалльной системе:

«зачтено»

«не зачтено»

Компетенция	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции	Критерии оценивания	Зачтено	Не зачтено
ОК-1	Уметь определять взаимосвязи между функциональными стратегиями подготавливать; принимать сбалансированные управленческие решения в условиях риска	Тест	Выполнение теста на 70-100%	Выполнение менее 70%
	Владеть навыками анализа функциональных стратегий организации навыками принятия сбалансированных	Решение стандартных практических задач	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены

	управленческих решений на основе результатов анализа взаимосвязи функциональных стратегий;			
	Владеть основными приёмами управления в условиях повышенного риска, самооценки профессиональной деятельности; подходами к совершенствованию творческого потенциала	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены
ОК-3	Знать: <ul style="list-style-type: none"> <li>• современные стратегические тактические инструменты управления организацией;</li> <li>• технологию построения процессов принятия решения в условиях риска;</li> </ul>	Тест	Выполнение теста на 70-100%	Выполнение менее 70%
	Уметь <ul style="list-style-type: none"> <li>• применять современные модели управления в условиях неопределенности ;</li> <li>• организовывать командное взаимодействие для решения поставленных задач в условиях риска</li> <li>• применять подходы управления по ценностям, разрабатывать анализировать корпоративную</li> </ul>	Решение стандартных практических задач	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены

	культуру компании, оценивать ее потенциал			
	<p>Владеть</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>аналитическими модели и количественными и методами управления риском;</li> <li>навыками контроля и оценки и деятельности подразделений и сотрудников.</li> </ul>	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены
ПК-2	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>Причины возникновения рисков событий и последствия возникшие в ходе их решения;</li> <li>Способы разрешения и предупреждения рисков.</li> </ul>	Тест	Выполнение теста на 70-100%	Выполнение менее 70%
	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>анализировать риски и применять эффективные методы их разрешения.</li> <li>систематизировать данные, полученные в ходе научного наблюдения, формировать гипотезы;</li> <li>адекватно оценивать поведение в рискованных ситуациях</li> </ul>	Решение стандартных практических задач	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены
	<p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>конструктивно действовать в ситуациях неопределенности</li> </ul>	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены

	<ul style="list-style-type: none"> <li>• основами предупреждения и разрешения рискованных ситуаций</li> </ul>			
ПК-4	Знать методы анализа и синтеза информации.	Тест	Выполнение теста на 70-100%	Выполнение менее 70%
	Уметь абстрактно мыслить, анализировать и обобщать полученную в ходе исследования информацию.	Решение стандартных практических задач	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены
	Знать основы стратегического управления, функциональные стратегии организации; методы управления риском для стратегического анализа.	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Продемонстрирован верный ход решения в большинстве задач	Задачи не решены

## **7.2 Примерный перечень оценочных средств (типичные контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности)**

### **7.2.1 Примерный перечень заданий для подготовки к тестированию**

1. Какая категория является наиболее рискованной для компании с точки зрения вероятного мошенничества и нарушения безопасности?

- A. Сотрудники
- B. Хакеры
- C. Атакующие
- D. Контрагенты (лица, работающие по договору)

2. Что самое главное должно продумать руководство при классификации данных?

- A. Типы сотрудников, контрагентов и клиентов, которые будут иметь доступ к данным
- B. Необходимый уровень доступности, целостности и

конфиденциальности

C. Оценить уровень риска и отменить контрмеры

D. Управление доступом, которое должно защищать данные

3. Кто в конечном счете несет ответственность за гарантии того, что данные классифицированы и защищены?

A. Владельцы данных

B. Пользователи

C. Администраторы

D. Руководство

4. Какой фактор наиболее важен для того, чтобы быть уверенным в успешном обеспечении безопасности в компании?

A. Поддержка высшего руководства

B. Эффективные защитные меры и методы их внедрения

C. Актуальные и адекватные политики и процедуры безопасности

D. Проведение тренингов по безопасности для всех сотрудников

5. Когда целесообразно не предпринимать никаких действий в отношении выявленных рисков?

A. Никогда. Для обеспечения хорошей безопасности нужно учитывать и снижать все риски

B. Когда риски не могут быть приняты во внимание по политическим соображениям

C. Когда необходимые защитные меры слишком сложны

D. Когда стоимость контрмер превышает ценность актива и потенциальные потери

6. Что такое политики безопасности?

- A. Пошаговые инструкции по выполнению задач безопасности
- B. Общие руководящие требования по достижению определенного уровня безопасности
- C. Широкие, высокоуровневые заявления руководства
- D. Детализированные документы по обработке инцидентов безопасности

7. Какая из приведенных техник является самой важной при выборе конкретных защитных мер?

- A. Анализ рисков
- B. Анализ затрат / выгоды
- C. Результаты ALE
- D. Выявление уязвимостей и угроз, являющихся причиной риска

8. Что лучше всего описывает цель расчета ALE?

- A. Количественно оценить уровень безопасности среды
- B. Оценить возможные потери для каждой контрмеры
- C. Количественно оценить затраты / выгоды
- D. Оценить потенциальные потери от угрозы в год

9. Тактическое планирование – это:

- A. Среднесрочное планирование
- B. Долгосрочное планирование
- C. Ежедневное планирование
- D. Планирование на 6 месяцев



10. Что является определением воздействия (exposure) на безопасность?

- A. Нечто, приводящее к ущербу от угрозы
- B. Любая потенциальная опасность для информации или систем
- C. Любой недостаток или отсутствие информационной безопасности
- D. Потенциальные потери от угрозы

### **7.2.2 Примерный перечень заданий для решения стандартных задач**

1. Эффективная программа безопасности требует сбалансированного применения:

- A. Технических и нетехнических методов
- B. Контрмер и защитных механизмов
- C. Физической безопасности и технических средств защиты
- D. Процедур безопасности и шифрования

2. Функциональность безопасности определяет ожидаемую работу механизмов безопасности, а гарантии определяют:

- A. Внедрение управления механизмами безопасности
- B. Классификацию данных после внедрения механизмов безопасности
- C. Уровень доверия, обеспечиваемый механизмом безопасности
- D. Соотношение затрат / выгод

3. Как рассчитать остаточный риск?

- A. Угрозы x Риски x Ценность актива
- B. (Угрозы x Ценность актива x Уязвимости) x Риски
- C.  $SLE \times Частоту = ALE$
- D. (Угрозы x Уязвимости x Ценность актива) x Недостаток контроля

4. Что из перечисленного не является целью проведения анализа рисков?

A. Делегирование полномочий

B. Количественная оценка воздействия потенциальных угроз

C. Выявление рисков

D. Определение баланса между воздействием риска и стоимостью необходимых контрмер

5. Что из перечисленного не является задачей руководства в процессе внедрения и сопровождения безопасности?

A. Поддержка

B. Выполнение анализа рисков

C. Определение цели и границ

D. Делегирование полномочий

6. Почему при проведении анализа информационных рисков следует привлекать к этому специалистов из различных подразделений компании?

A. Чтобы убедиться, что проводится справедливая оценка

B. Это не требуется. Для анализа рисков следует привлекать небольшую группу специалистов, не являющихся сотрудниками компании, что позволит обеспечить беспристрастный и качественный анализ

C. Поскольку люди в различных подразделениях лучше понимают риски в своих подразделениях и смогут предоставить максимально полную и достоверную информацию для анализа

D. Поскольку люди в различных подразделениях сами являются одной из причин рисков, они должны быть ответственны за их оценку

7. Что является наилучшим описанием количественного анализа рисков?

A. Анализ, основанный на сценариях, предназначенный для выявления различных угроз безопасности

B. Метод, используемый для точной оценки потенциальных потерь, вероятности потерь и рисков

C. Метод, сопоставляющий денежное значение с каждым компонентом оценки рисков

D. Метод, основанный на суждениях и интуиции

8. Почему количественный анализ рисков в чистом виде не достижим?

A. Он достижим и используется

B. Он присваивает уровни критичности. Их сложно перевести в денежный вид.

C. Это связано с точностью количественных элементов

D. Количественные измерения должны применяться к качественным элементам

9. Какой из следующих законодательных терминов относится к компании или человеку, выполняющему необходимые действия, и используется для определения обязательств?

A. Стандарты

B. Должный процесс (Due process)

C. Должная забота (Due care)

D. Снижение обязательств

10. Какая категория является наиболее рискованной для компании с точки зрения вероятного мошенничества и нарушения безопасности?

A. Сотрудники

B. Хакеры

C. Атакующие

D. Контрагенты (лица, работающие по договору)

### **7.2.3 Примерный перечень заданий для решения прикладных задач**

1 Что самое главное должно продумать руководство при классификации данных?

A. Типы сотрудников, контрагентов и клиентов, которые будут иметь доступ к данным

B. Необходимый уровень доступности, целостности и конфиденциальности

C. Оценить уровень риска и отменить контрмеры

D. Управление доступом, которое должно защищать данные

2. Кто в конечном счете несет ответственность за гарантии того, что данные классифицированы и защищены?

A. Владельцы данных

B. Пользователи

C. Администраторы

D. Руководство

3. Какой фактор наиболее важен для того, чтобы быть уверенным в успешном обеспечении безопасности в компании?

A. Поддержка высшего руководства

B. Эффективные защитные меры и методы их внедрения

C. Актуальные и адекватные политики и процедуры безопасности

D. Проведение тренингов по безопасности для всех сотрудников

4. Когда целесообразно не предпринимать никаких действий в отношении выявленных рисков?

А. Никогда. Для обеспечения хорошей безопасности нужно учитывать и снижать все риски

В. Когда риски не могут быть приняты во внимание по политическим соображениям

С. Когда необходимые защитные меры слишком сложны

Д. Когда стоимость контрмер превышает ценность актива и потенциальные потери

5. Что такое политики безопасности?

А. Пошаговые инструкции по выполнению задач безопасности

В. Общие руководящие требования по достижению определенного уровня безопасности

С. Широкие, высокоуровневые заявления руководства

Д. Детализированные документы по обработке инцидентов безопасности

6. Какая из приведенных техник является самой важной при выборе конкретных защитных мер?

А. Анализ рисков

В. Анализ затрат / выгоды

С. Результаты ALE

Д. Выявление уязвимостей и угроз, являющихся причиной риска

7. Что лучше всего описывает цель расчета ALE?

А. Количественно оценить уровень безопасности среды

В. Оценить возможные потери для каждой контрмеры

С. Количественно оценить затраты / выгоды

Д. Оценить потенциальные потери от угрозы в год

8. Тактическое планирование – это:

- A. Среднесрочное планирование
- B. Долгосрочное планирование
- C. Ежедневное планирование
- D. Планирование на 6 месяцев

9. Что является определением воздействия (exposure) на безопасность?

- A. Нечто, приводящее к ущербу от угрозы
- B. Любая потенциальная опасность для информации или систем
- C. Любой недостаток или отсутствие информационной безопасности
- D. Потенциальные потери от угрозы

10. Эффективная программа безопасности требует сбалансированного применения:

- A. Технических и нетехнических методов
- B. Контрмер и защитных механизмов
- C. Физической безопасности и технических средств защиты
- D. Процедур безопасности и шифрования

11. Функциональность безопасности определяет ожидаемую работу механизмов безопасности, а гарантии определяют:

- A. Внедрение управления механизмами безопасности
- B. Классификацию данных после внедрения механизмов безопасности
- C. Уровень доверия, обеспечиваемый механизмом безопасности
- D. Соотношение затрат / выгод

#### **7.2.4 Примерный перечень вопросов для подготовки к зачету**

1. Методологические основы принятия риск-решений;
2. Методология адаптивного динамического управления рисками
3. Обоснуйте связь риск-менеджмента с функциональными службами
4. Раскройте особенности работы с персоналом фирмы с целью недопущения кадрового риска.
5. Охарактеризуйте основные внутрифирменные источники снижения риска.
6. Охарактеризуйте взаимосвязь понятий неопределенности и риска.
7. Назовите основные причины, порождающие неопределенность.
8. Понятийный аппарат управления рисками
9. Цели и задачи управления рисками
10. Назовите основные задачи при управлении риском
11. Как называется ситуационный, особый способ решения проблемы
12. Характеристика рисков в различных сферах предпринимательской деятельности
13. Основные принципы управления риском.
14. Количественная оценка риска
15. Анализ риска: зонирование риска
16. Управление рисками в производственном комплексе
17. Методы управления финансовыми рисками
18. Управление риском в банковской системе
19. Инвестиционный менеджмент и риск
20. Методы оценки регионального инвестиционного риска
21. Охарактеризуйте метод поэтапной оценки риска.
22. Покажите особенности формирования вопросов и составления анкет при экспертном методе анализа риска.
23. Свойства риска

24. Теоретические аспекты риск-менеджмента.
25. Принятие решений в условиях риска
26. Риск-менеджмент в страховании
27. Управление рисками и антикризисное управление.
28. Методы снижения степени риска
29. Управление риском методом «причины-факторы-противорисковые мероприятия»

### **7.2.5 Примерный перечень заданий для решения прикладных задач**

Не предусмотрено учебным планом

### **7.2.6. Методика выставления оценки при проведении промежуточной аттестации**

Критерии оценки компетенций, знаний, умений и навыков по дисциплине устанавливает кафедра, обеспечивающая дисциплину, по согласованию с выпускающей кафедрой.

Зачет проводится по вопросам в устной и/или письменной форме:

- два вопроса, которые предполагают развернутый ответ.

Выставление оценки:

«Отлично» от 85 % (процент раскрытия материала предполагаемого экзаменационным билетом или процент правильных ответов)

«Хорошо» от 65 % (процент раскрытия материала предполагаемого экзаменационным билетом или процент правильных ответов)

«Удовлетворительно» от 45 % (процент раскрытия материала предполагаемого экзаменационным билетом или процент правильных ответов)

«Неудовлетворительно» меньше 45 % (процент раскрытия материала предполагаемого экзаменационным билетом или процент правильных ответов).

### **7.2.7 Паспорт оценочных материалов**

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Код контролируемой компетенции	Наименование оценочного средства
1	Основные понятия и природа возникновения риска	ОК-1, ОК-3, ПК-2, ПК-4	Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту....
2	Риск в бизнес-планировании и бюджетировании	ОК-1, ОК-3, ПК-2, ПК-4	Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту....
3	Риск-менеджмент. Стратегия управления	ОК-1, ОК-3, ПК-2,	Тест, контрольная работа,



	риском	ПК-4	защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту....
4	Методы оценки, анализа и прогнозирования риска	ОК-1, ОК-3, ПК-2, ПК-4	Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту....
5	Управление рисками	ОК-1, ОК-3, ПК-2, ПК-4	Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту....
6	Психологические аспекты управления риском	ОК-1, ОК-3, ПК-2, ПК-4	Тест, контрольная работа, защита лабораторных работ, защита реферата, требования к курсовому проекту....

### **7.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности**

Тестирование осуществляется, либо при помощи компьютерной системы тестирования, либо с использованием выданных тест-заданий на бумажном носителе. Время тестирования 30 мин. Затем осуществляется проверка теста экзаменатором и выставляется оценка согласно методики выставления оценки при проведении промежуточной аттестации.

Решение стандартных задач осуществляется, либо при помощи компьютерной системы тестирования, либо с использованием выданных задач на бумажном носителе. Время решения задач 30 мин. Затем осуществляется проверка решения задач экзаменатором и выставляется оценка, согласно методики выставления оценки при проведении промежуточной аттестации.

Решение прикладных задач осуществляется, либо при помощи компьютерной системы тестирования, либо с использованием выданных задач на бумажном носителе. Время решения задач 30 мин. Затем осуществляется проверка решения задач экзаменатором и выставляется оценка, согласно методики выставления оценки при проведении промежуточной аттестации.

Защита курсовой работы, курсового проекта или отчета по всем видам практик осуществляется согласно требованиям, предъявляемым к работе, описанным в методических материалах. Примерное время защиты на одного студента составляет 20 мин.

## **8 УЧЕБНО МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ)**

### **8.1 Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины**

1. Баркалов, Сергей Алексеевич, Киреева, Екатерина Александровна, Семенов, Петр Иванович

- Управление рисками:учеб.-метод. комплекс. - Воронеж : Научная книга, 2012 -479 с.
2. Маховикова Галина Афанасьевна, Касьяненко Татьяна Геннадьевна  
Анализ и оценка рисков в бизнесе:учебник для академического бакалавриата : допущено УМО. - Москва: Юрайт , 2014 -464 с.
  3. Киселева И. А.  
Моделирование рискованных ситуаций:Учебное пособие. - Москва : Евразийский открытый институт, 2011 -152 с.
  4. Шапкин А. С., Шапкин В. А.  
Теория риска и моделирование рискованных ситуаций:Учебник. - Москва : Дашков и К, 2014 -880 с.
  5. Суглобов А. Е., Хмелев С. А., Орлова Е. А.  
Экономическая безопасность предприятия:Учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности «Экономическая безопасность». - Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2013 -271 с
  6. Риск-менеджмент инвестиционного проекта:учебник : рек. УМО. - М. : Юнити, 2009 -544 с.
  7. Шапкин, Александр Сергеевич, Шапкин, Виктор Александрович  
Теория риска и моделирование рискованных ситуаций:учебник для вузов : допущено МО РФ. - 4-е изд.. - М. : Дашков и К, 2009 -879 с.
  8. Казакова, Н. А.  
Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски:учеб. пособие : рек. УМО. - М. : Инфра-М, 2011 -207 с.
  9. Антикризисное управление: механизмы государства, технологии бизнеса:учебник и практикум для академического бакалавриата : рекомендовано Учебно-методическим отделом. - Москва : Юрайт, 2015 -639 с.
  - 10.Балдин К. В., Передеряев И. И., Рукосуев А. В. Антикризисное управление. Макро- и микроуровень:Учебное пособие. - Москва : Дашков и К, 2013 -268 с., <http://www.iprbookshop.ru/14596>

**8.2 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень лицензионного программного обеспечения, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем:**

Комплект лицензионного программного обеспечения - Академическая лицензия на использование программного обеспечения Microsoft Office;

**Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:**

- Министерство экономического развития  
<http://www.economy.gov.ru/mines/main>
- Агентство инноваций и развития экономических и социальных проектов Воронежской области – <https://www.innogos.ru>
- Официальный сайт Министерства образования и науки Российской Федерации – <http://www.minedu.gov.ru>

Федерации – <http://www.mon.gov.ru>  
– Госкомстат России – <http://www.gks.ru>  
– Территориальный орган Федеральной службы государственной статистики по Воронежской области – <http://voronezhstat.gks.ru>

### **Информационно-справочные системы:**

Справочная Правовая Система Консультант Плюс:  
Электронный периодический справочник «Система ГАРАНТ»  
[www.bcg.ru](http://www.bcg.ru) (сайт ВСГ)  
[www.cfin.ru/consulting](http://www.cfin.ru/consulting) (Теория и практика консалтинговой деятельности)  
[www.deloitte.com](http://www.deloitte.com) (сайт компании «Делойт»)  
[www.expert.ru](http://www.expert.ru) (электронная версия журнала «Эксперт»)  
[www.feaco.org](http://www.feaco.org) (Европейская Ассоциация Консалтинговых услуг)

### **Современные профессиональные базы данных:**

– Федеральный портал «Российское образование» – <http://www.edu.ru>  
– Информационная система «Единое окно доступа к образовательным ресурсам» – <http://window.edu.ru>  
– Единая коллекция цифровых образовательных ресурсов – <http://school-collection.edu.ru>  
– Федеральный центр информационно-образовательных ресурсов – <http://fcior.edu.ru>

## **9 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКАЯ БАЗА, НЕОБХОДИМАЯ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА**

1. Электронно-библиотечная система Znanium: [https://znanium.com/](http://https://znanium.com/)
2. Научно-электронная Библиотека: ГПНТБ России: <http://http://ellib.gpntb.ru/>
3. Российская Государственная библиотека: <http://www/rsl.ru>.
4. Электронная библиотека IPRbooks: [www.iprbookshop.ru](http://www.iprbookshop.ru)
5. Консультант плюс <https://www.consultant.ru>
6. Системе СПАРК-Интерфакс [https://www.spark-interfax.ru/#\\_top](https://www.spark-interfax.ru/#_top)
7. Интегрум. Ведущий поставщик деловой информации <https://integrum.ru/> и другие аналоги – системы поставляющие информацию о компаниях
8. CRM-система для компаний <https://megaplan.ru>
9. SRM-система <https://www.bitrix24.ru>
10. SCM системы <https://astorsoft.ru>
11. Поисковые системы «Яндекс» и «Goole» для доступа к информационным ресурсам.

## **10. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

По дисциплине «Риск-менеджмент» читаются лекции, проводятся практические занятия, выполняется курсовая работа.

Основой изучения дисциплины являются лекции, на которых излагаются наиболее существенные и трудные вопросы, а также вопросы, не нашедшие отражения в учебной литературе.

Практические занятия направлены на приобретение практических навыков и анализа конфликтных ситуаций. Занятия проводятся путем решения конкретных задач в аудитории.

Методика выполнения курсовой работы изложена в учебно-методическом пособии. Выполнять этапы курсовой работы должны своевременно и в установленные сроки.

Контроль усвоения материала дисциплины производится проверкой курсовой работы, защитой курсовой работы.

Вид учебных занятий	Деятельность студента
Лекция	Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначение вопросов, терминов, материала, которые вызывают трудности, поиск ответов в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на лекции или на практическом занятии.
Практическое занятие	Конспектирование рекомендуемых источников. Работа с конспектом лекций, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы. Прослушивание аудио- и видеозаписей по заданной теме, выполнение расчетно-графических заданий, решение задач по алгоритму.
Самостоятельная работа	Самостоятельная работа студентов способствует глубокому усвоению учебного материала и развитию навыков самообразования. Самостоятельная работа предполагает следующие составляющие: - работа с текстами: учебниками, справочниками, дополнительной литературой, а также проработка конспектов лекций; - выполнение домашних заданий и расчетов; - работа над темами для самостоятельного изучения; - участие в работе студенческих научных конференций, олимпиад; - подготовка к промежуточной аттестации.
Подготовка к промежуточной аттестации	Готовиться к промежуточной аттестации следует систематически, в течение всего семестра. Интенсивная подготовка должна начаться не позднее, чем за месяц-полтора до промежуточной аттестации. Данные перед зачетом три дня эффективнее всего использовать для повторения и систематизации материала.