

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Маланичева Наталья Николаевна
Должность: директор филиала
Дата подписания: 17.01.2025 15:18:57
Уникальный программный ключ:
94732c3d953a82d495dcc3155d5c573883fedd18

**МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПУТЕЙ СООБЩЕНИЯ
(СамГУПС)**

Филиал СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

РАССМОТРЕНА
на заседании Ученого совета филиала
СамГУПС в г. Нижнем Новгороде
протокол от 22 июня 2021 г. № 3

УТВЕРЖДАЮ:
и.о. директора филиала
Н.Н. Маланичева
12 июля 2021 г.



Оценка и анализ рисков
рабочая программа дисциплины

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Экономика и финансы предприятий
(организаций)

Форма обучения: очно-заочная

Нижний Новгород 2021

Программу составил: Галанина Е.Г.

Рабочая программа разработана в соответствии с ФГОС:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика утвержден приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от «12» августа 2020 г. № 954.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины»

Протокол от «19» июня 2021 г. № 10

Зав. кафедрой, канд. техн. наук, проф. _____



Подпись

И.В. Каспаров

Лист переутверждения РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2022-2023 учебном году на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины»
с изменениями/дополнениями

Протокол от «18» _____ июня _____ 2022 г. № 10

Зав. кафедрой, канд. тех. наук, профессор _____ И.В. Каспаров

Согласовано и переутверждено:

решением Ученого совета филиала СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

Протокол от «28» _____ июня _____ 2022 г. № 1

Лист переутверждения РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2023-2024 учебном году на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины»
с изменениями/дополнениями

Протокол от «___» _____ 2023 г. № _____

Зав. кафедрой, канд. тех. наук, профессор _____ И.В. Каспаров

Согласовано и переутверждено:

решением Ученого совета филиала СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

Протокол от «___» _____ 2023 г. № _____

Лист переутверждения РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2024-2025 учебном году на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины»
с изменениями/дополнениями

Протокол от «___» _____ 2024 г. № _____

Зав. кафедрой, канд. тех. наук, профессор _____ И.В. Каспаров

Согласовано и переутверждено:

решением Ученого совета филиала СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

Протокол от «___» _____ 2024 г. № _____

Лист переутверждения РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2025-2026 учебном году на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины»
с изменениями/дополнениями

Протокол от «___» _____ 2025 г. № _____

Зав. кафедрой, канд. тех. наук, профессор _____ И.В. Каспаров

Согласовано и переутверждено:

решением Ученого совета филиала СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

Протокол от «___» _____ 2025 г. № _____

**Лист актуализации РПД «Оценка и анализ рисков»
на 2022-2023 учебный год**

Актуализируется:

раздел 7. Перечень основной и дополнительной литературы

7.1. Основная литература				
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество
Л1.1	Герасимов, А.Н.	Оценка и анализ рисков : учебник	Москва: КноРус, 2022. - 251 с. - Режим доступа: https://book.ru/books/943147	Электронный ресурс
Л2.1	Е.А. Остапенко, С.А. Молчаненко; под общ. ред. Т.Г. Гурнович.	Оценка и анализ рисков : учебник	Москва : КноРус, 2022. - 251 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/943147	Электронный ресурс
7.2. Дополнительная литература				
Л2.1	Струченкова, Т.В.	Валютные риски: анализ и управление : учебное пособие	Москва: КноРус, 2021. - 210 с. - Режим доступа: https://book.ru/books/936298	Электронный ресурс
Л2.2	Багратуни К.Ю., Данилина М.В.	Риски: анализ и оценка : учебное пособие	Москва: Русайнс, 2020. - 136 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/935149	Электронный ресурс

Зав. кафедрой, канд. техн. наук, проф. _____


подпись

И.В. Каспаров

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

1.1. Цели и задачи дисциплины (модуля)

Целью освоения учебной дисциплины «Оценка и анализ рисков» является формирование у обучающихся компетенций в соответствии с требованиями федерального государственного образовательного стандарта.

Цели изучения дисциплины: создание теоретической и методологической основы для овладения знаниями в области оценки риска, формирование представлений по диагностике и анализу рисков.

Основными задачами изучения дисциплины являются формирование у обучающихся знаний о закономерностях функционирования организации в условиях риска, методах управления рисками, принципах разработки, оценки эффективности и реализации решений по управлению рисками, обучение методам систематизации и обобщения информации о рисках деятельности организации, выработка навыков использования количественных и качественных методов идентификации и анализа рисков.

1.2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)

Компетенции и индикаторы, формируемые в процессе изучения дисциплины	Результаты освоения учебной дисциплины
ПК-2. Способен проводить финансовый анализ, бюджетирование и управление денежными потоками	
ПК-2.4. Анализирует и оценивает финансовые риски, разрабатывает меры по их минимизации	Знать: - источники информации для оценки риска; - критерии уровня риска; - основные методологические подходы к оценке рисков на транспортных предприятиях Уметь: - оценивать варианты управленческих решений в условиях рисков; - разработать и обосновать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев уровня риска; - применять системный подход для решения поставленных задач Владеть: - методами анализа и синтеза информации для оценки риска; - методикой разработки системных подходов решения поставленных задач с учетом критериев уровня риска; - методикой оценки риска и возможных экономических последствий

2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Учебная дисциплина «Оценка риска» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 «Дисциплины (модули)» и является обязательной для изучения.

Код	Наименование дисциплины	Коды формируемых
-----	-------------------------	------------------

дисциплины		компетенций, индикаторов
Осваиваемая дисциплина		
Б1.В.11	Оценка и анализ рисков	ПК-2 (ПК-2.4)
Предшествующие дисциплины		
Б1.В.08	Финансовый менеджмент	ПК-2 (ПК-2.4)
Дисциплины, осваиваемые параллельно		
Б1.В.ДВ.04.01	Тактика и стратегия финансирования деятельности организации	ПК-2 (ПК-2.4)
Б1.В.ДВ.04.02	Инвестиционная стратегия предприятия	ПК-2 (ПК-2.4)
Последующие дисциплины		
Б3.01	Выполнение, подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы	ПК-2 (ПК-2.4)

3. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделяемых на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

3.1. Распределение объема учебной дисциплины (модуля) на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	Всего часов по учебному плану	Курсы (семестры)
		4(8)
Общая трудоемкость дисциплины:		
- часов	180	180
- зачетных единиц	5	5
Контактная работа обучающихся с преподавателем (всего), часов	50,75	50,75
<i>из нее аудиторные занятия, всего</i>	50,75	50,75
в т.ч. лекции	24	24
практические занятия	24	24
лабораторные работы		
КА	0,4	0,4
КЭ	2,35	2,35
Самостоятельная подготовка к экзаменам в период экзаменационной сессии (контроль)	24,65	24,65
Самостоятельная работа	104,6	104,6
в том числе на выполнение:		
контрольной работы		
расчетно-графической работы	18	18
реферата		
курсовой работы		
курсового проекта		
Виды промежуточного контроля	РГР(1)	РГР(1)
Текущий контроль (вид, количество)	Эк	Эк

4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

4.1. Темы и краткое содержание курса

Тема 1. Понятие риска и его природа

Полная неопределенность. Частичная неопределенность. Ситуация риска (рискованная ситуация). Характерные черты рискованных ситуаций. Субъект риска (носитель риска). Составляющие элементы риска. Функции риска. Характеристики риска. Взгляды представителей экономических школ на риск.

Тема 2. Риски внешней и внутренней среды

Риски внешней среды организации. Риски макросреды. Отраслевые риски. Риски ауры. Внешние риски. Экономическая система. Технологическая система. Информационные и социальные системы. Внутренние риски.

Тема 3. Диагностика рисков компании

Суть диагностики рисков. Зоны риска. Виды диагностики. Этапы диагностики. Картографирование рисков фирмы.

Тема 4. Методы оценки рисков

Метод оценки. Качественные методы. Количественные методы оценки риска. Оценка показателей риска на основе анализа экономических показателей. Вероятностные показатели оценки риска. Статистические показатели риска.

Тема 5. Макроэкономические и политические риски

Макроэкономические риски. Политический риск. Источники политического риска. Виды политического риска. Методы оценки политического риска.

Тема 6. Риски отношений в альянсах

Риск, связанный с формированием стратегии альянса. Риски, связанные с ресурсами альянсов. Особенность рисков отношений в альянсе.

Тема 7. Риски, связанные с человеческим фактором

Виды рисков: поведенческие риски; риск конфликтов; риск нелояльности; риск некомпетентности и непрофессионализма.

Тема 8. Операционные риски и финансовые риски

Операционный риск. Финансовый риск. Причины операционных рисков. Причины операционных рисков. Риски, связанные с покупательной способностью денег. Риски, связанные с вложением капитала (инвестиционные риски).

Тема 9. Методы управления рисками

Метод управления рисками. Этапы управления рисками. Перенос и передача риска. Уклонение от риска. Самострахование. Распределение и диссипация риска. Диверсификация и концентрация риска. Лимитирование концентрации риска. Прямое директивное управление риском. Страхование риска. Хеджирование риска. Организационная структура службы управления рисками

4.2. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам

Названия разделов и тем	Всего часов по учебному	Виды учебных занятий	
		Контактная работа (Аудиторная работа)	СР

	плану	ЛЗ	ПЗ	
Тема 1. Понятие риска и его природа	12,6	2	2	8,6
Тема 2. Риски внешней и внутренней среды	16	2	2	12
Тема 3. Диагностика рисков компании	16	2	2	12
Тема 4. Методы оценки рисков	16	2	2	12
Тема 5. Макроэкономические и политические риски	16	2	2	12
Тема 6. Риски отношений в альянсах	16	2	2	12
Тема 7. Риски, связанные с человеческим фактором	16	2	2	12
Тема 8. Операционные риски и финансовые риски	24	6	6	12
Тема 9. Методы управления рисками	20	4	4	12
КА	0,4			
КЭ	2,35			
Контроль	24,65			
Всего за 8 семестр	180	24	24	104,6
ИТОГО за 4 курс	180	24	24	104,6

4.3. Тематика практических занятий

Тема практического занятия	Количество часов
Тема 1. Понятие риска и его природа	2
Тема 2. Риски внешней и внутренней среды	2
Тема 3. Диагностика рисков компании	2
Тема 4. Методы оценки рисков	2
Тема 5. Макроэкономические и политические риски	2
Тема 6. Риски отношений в альянсах	2
Тема 7. Риски, связанные с человеческим фактором	2
Тема 8. Операционные риски и финансовые риски	6
Тема 9. Методы управления рисками	4
Всего за 8 семестр	24
ИТОГО за 4 курс	24

4.4. Тематика лабораторных работ

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

4.5. Тематика курсовых работ (проектов)

Курсовые работы (проекты) учебным планом не предусмотрены.

4.6. Тематика расчетно-графических работ

1. Экономические показатели, характеризующие предпринимательские риски.
2. Факторы, влияющие на уровень предпринимательских рисков.
3. Методики оценки рисков хозяйствующих субъектов.
4. Методы оценки предпринимательских рисков.
5. Основные направления и методы снижения предпринимательских рисков.
6. Оценка рисков с помощью методов качественного и количественного анализа рисков.
7. Оценка финансовых рисков компании.
8. Использование современных методов оценки рыночных рисков для принятия эффективных управленческих решений.

9. Основы построения системы риск-менеджмента на предприятии.
10. Анализ системы управления рисками в деятельности предприятий на территории России.
11. Коммерческий риск инновационной деятельности.
12. Основные положения современной теории рисков.
13. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска.

4.7. Тематика рефератов

Рефераты учебным планом не предусмотрены.

5. Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

5.1. Распределение часов по темам и видам самостоятельной работы

Разделы и темы	Всего часов по учебному плану	Вид самостоятельной работы
Тема 1. Понятие риска и его природа	8,6	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение РГР Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 2. Риски внешней и внутренней среды	12	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение РГР Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 3. Диагностика рисков компании	12	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение РГР Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 4. Методы оценки рисков	12	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение РГР Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 5. Макроэкономические и политические риски	12	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение РГР Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 6. Риски отношений в альянсах	12	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение РГР Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 7. Риски,	12	Самостоятельное изучение отдельных тем

связанные с человеческим фактором		учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение РГР Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 8. Операционные риски и финансовые риски	12	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение РГР Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 9. Методы управления рисками	12	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение РГР Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Всего	104,6	

5.2. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся с указанием места их нахождения:

- учебная литература - библиотека филиала;
- методические рекомендации по самостоятельному изучению теоретического материала - сайт филиала.

6. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю)

Вид оценочных средств	Количество
Текущий контроль	
Курсовая работа (проект)	-
Расчетно-графическая работа	1
Реферат	-
Промежуточный контроль	
Зачет	-
Зачет с оценкой	-
Экзамен	1

Фонд оценочных средств представлен в приложении к рабочей программе

7. Перечень основной и дополнительной литературы

7.1. Основная литература				
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество
Л1.1	Герасимов, А.Н.	Оценка и анализ рисков : учебник	Москва: КноРус, 2019. — 251 с. - Режим доступа https://www.book.ru/book/938238	Электронный ресурс
7.2. Дополнительная литература				
Л2.1	Струченкова, Т.В.	Валютные риски: анализ и управление : учебное пособие	Москва: КноРус, 2016. — 210 с. - Режим доступа https://www.book.ru/book/920593	Электронный ресурс
Л2.2	Данилина, М.В.	Риски: анализ и оценка : учебное	Москва: Русайнс, 2020. — 136 с. - Режим доступа	Электронный ресурс

		пособие	https://www.book.ru/book/921913/	
--	--	---------	---	--

8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля)

1. Официальный сайт филиала.
2. Электронная библиотечная система.

9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

1. Лекционные занятия включают в себя конспектирование учебного материала, на занятиях необходимо иметь тетрадь для записи и необходимые канцелярские принадлежности.

2. Практические занятия включают в себя решение задач по темам. Для подготовки к практическим занятиям необходимо заранее ознакомиться с рекомендованной литературой. На занятии необходимо иметь конспект лекции, методические указания по выполнению заданий. Во время выполнения заданий обучающиеся заполняют отчет, который защищают у преподавателя в конце занятия.

3. В рамках самостоятельной работы обучающиеся должны выполнить расчетно-графическую работу. Прежде чем выполнять задания расчетно-графической работы необходимо изучить нормативно-правовую и методическую литературу. Выполнение и защита расчетно-графической работы являются непременным условием для допуска к экзамену. Во время выполнения расчетно-графической работы можно получить групповые или индивидуальные консультации у преподавателя.

10. Перечень информационных технологий, программного обеспечения и информационных справочных систем, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю)

При осуществлении образовательного процесса по дисциплине используются следующие информационные технологии и программное обеспечение:

- для проведения лекций, демонстрации презентаций и ведения интерактивных занятий: MS PowerPoint;
- для выполнения практических занятий: Microsoft Office 2003 и выше;
- для самостоятельной работы обучающихся: Windows 7 и выше, Microsoft Office 2003 и выше;
- для оформления отчетов и иной документации: Microsoft Office 2003 и выше.

11. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

11.1. Требования к аудиториям (помещениям, кабинетам) для проведения занятий с указанием соответствующего оснащения

Учебная аудитория для проведения учебных занятий, предусмотренных программой бакалавриата (проведение занятий лекционного типа, занятий

семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации) - кабинет «Экономики», аудитория № 602. Специализированная мебель: столы ученические - 23 шт., стулья ученические - 46 шт., доска настенная - 1 шт., стол преподавателя - 1 шт., стул преподавателя - 1 шт. Технические средства обучения: переносной экран, переносной проектор, ноутбук. Учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации, соответствующие рабочей программе дисциплины - комплект презентаций (хранится на кафедре).

11.2. Перечень лабораторного оборудования

Лабораторное оборудование не предусмотрено.

**ФОНД
ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

по учебной дисциплине

ОЦЕНКА И АНАЛИЗ РИСКОВ

1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения учебной дисциплины (модуля)

1.1. Перечень компетенций и индикаторов

ПК-2. Способен проводить финансовый анализ, бюджетирование и управление денежными потоками.

Индикатор ПК-2.4. Анализирует и оценивает финансовые риски, разрабатывает меры по их минимизации.

1.2. Этапы формирования компетенций в процессе освоения учебной дисциплины (модуля)

Наименование этапа	Содержание этапа (виды учебной работы)	Коды формируемых на этапе компетенций, индикаторов
Этап 1. Формирование теоретической базы знаний	Лекции, самостоятельная работа обучающихся с теоретической базой, практические занятия	ПК-2 (ПК-2.4)
Этап 2. Формирование умений	Практические занятия	ПК-2 (ПК-2.4)
Этап 3. Формирование навыков практического использования знаний и умений	Выполнение расчетно-графической работы	ПК-2 (ПК-2.4)
Этап 4. Проверка усвоенного материала	Защита расчетно-графической работы, экзамен	ПК-2 (ПК-2.4)

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

2.1. Показатели и критерии оценивания компетенций на различных этапах их формирования

Этап формирования компетенции	Код компетенции, индикатора	Показатели оценивания компетенций	Критерии	Способы оценки
Этап 1. Формирование теоретической базы знаний	ПК-2 (ПК-2.4)	- посещение лекционных занятий, практических занятий; - ведение конспекта лекций; - участие в обсуждении теоретических вопросов тем на каждом практическом занятии	- наличие конспекта лекций по всем темам, вынесенным на лекционное обсуждение; - активное участие обучающегося в обсуждении теоретических вопросов	устный ответ
Этап 2. Формирование умений (решение задачи по образцу)	ПК-2 (ПК-2.4)	- выполнение практических заданий	- успешное самостоятельное выполнение практических заданий	отчет по практическому занятию

Этап Формирование навыков практического использования знаний и умений	3.	ПК-2 (ПК-2.4)	- наличие правильной контрольной расчетно- графической работы	- расчетно- графическая работа имеет положительную рецензию и допущена к защите	расчетно- графическая работа
Этап Проверка усвоенного материала	4.	ПК-2 (ПК-2.4)	- успешная защита контрольной расчетно- графической работы; - ответы на вопросы экзамена	- ответы на вопросы экзамена	устный ответ

2.2. Критерии оценивания компетенций по уровню их сформированности

Код компетенции, индикатора	Уровни сформированности компетенций		
	базовый	средний	высокий
ПК-2 (ПК-2.4)	Знать: - источники информации для оценки риска Уметь: - оценивать варианты управленческих решений в условиях рисков Владеть: - методами анализа и синтеза информации для оценки риска	Знать: - критерии уровня риска Уметь: - разработать и обосновать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев уровня риска Владеть: - методикой разработки системных подходов решения поставленных задач с учетом критериев уровня риска	Знать: - основные методологические подходы к оценке рисков на транспортных предприятиях Уметь: - применять системный подход для решения поставленных задач Владеть: - методикой оценки риска и возможных экономические последствий

2.3. Шкалы оценивания формирования индикаторов достижения компетенций

а) Шкала оценивания экзамена

Шкала оценивания	Критерии оценивания
Оценка «отлично»	Индикатор достижения компетенции сформирован на высоком уровне и обучающийся отвечает на все дополнительные вопросы. Теоретическое содержание дисциплины освоено полностью, без пробелов. Обучающийся демонстрирует полное соответствие знаний, умений и навыков показателям и критериям оценивания индикатора достижения компетенции на формируемом дисциплиной уровне. Оперировать приобретенными знаниями, умениями и навыками, в том числе в ситуациях повышенной сложности. Отвечает на все вопросы билета без наводящих вопросов со стороны преподавателя. Не испытывает затруднений при ответе на дополнительные вопросы
Оценка «хорошо»	- Индикатор достижения компетенции сформирован на высоком уровне, или индикатор достижения компетенции сформирован на среднем уровне, но обучающийся аргументированно отвечает на все дополнительные вопросы;

	- индикатор достижения компетенции сформирован на среднем уровне, но обучающийся аргументированно отвечает на все дополнительные вопросы; - индикатор достижения компетенции сформирован на среднем уровне, или на базовом уровне, но обучающийся уверенно отвечает на все дополнительные вопросы. Теоретическое содержание дисциплины освоено полностью, без пробелов. Обучающийся демонстрирует полное соответствие знаний, умений и навыков показателям и критериям оценивания индикатора достижения компетенции на формируемом дисциплиной уровне. Опирается на приобретенными знаниями, умениями и навыками; его ответ представляет грамотное изложение учебного материала по существу; отсутствуют существенные неточности в формулировании понятий; правильно применены теоретические положения, подтвержденные примерами. На два теоретических вопроса обучающийся дал полные ответы, на третий - при наводящих вопросах преподавателя. При ответе на дополнительные вопросы допускает неточности.
Оценка «удовлетворительно»	- Индикатор достижения компетенции сформирован на базовом уровне; - индикатор достижения компетенции сформирован на базовом уровне, или на среднем уровне, но обучающийся затрудняется ответить на дополнительные вопросы. Теоретическое содержание дисциплины освоено частично, но проблемы не носят принципиального характера. Обучающийся демонстрирует неполное соответствие знаний, умений и навыков показателям и критериям оценивания индикатора достижения компетенции на формируемом дисциплиной уровне: допускаются значительные ошибки, проявляется отсутствие знаний по ряду вопросов. Затрудняется отвечать на дополнительные вопросы.
Оценка «неудовлетворительно»	Индикатор достижения компетенции сформирован на уровне ниже базового и обучающийся затрудняется ответить на дополнительные вопросы. Теоретическое содержание дисциплины освоено частично. Обучающийся демонстрирует явную недостаточность или полное отсутствие знаний, умений и навыков на заданном уровне сформированности индикаторов достижения компетенции.

б) Шкала оценивания расчетно-графической работы

Шкала оценивания	Критерии оценивания
Зачтено	Индикатор достижения компетенции сформирован на высоком уровне и обучающийся отвечает на все дополнительные вопросы. Все теоретические вопросы раскрыто полностью, изложены логично и последовательно. Проведен анализ, систематизация и обобщение литературных источников
Не зачтено	Индикатор достижения компетенции сформирован на уровне ниже базового и обучающийся затрудняется ответить на дополнительные вопросы. Теоретические вопросы не раскрыты или имеются серьезные ошибки и неточности при изложении ответа на вопросы

3. Типовые контрольные задания и иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций

Код компетенции, индикатора	Этапы формирования компетенции	Типовые задания (оценочные средства)
ПК-2 (ПК-2.4)	Этап 1. Формирование теоретической базы знаний	- Устный ответ

	Этап 2. Формирование умений (решение задачи по образцу)	- Практическое занятие
	Этап 3. Формирование навыков практического использования знаний и умений	- Расчетно-графическая работа перечень тем (методические рекомендации СР)
	Этап 4. Проверка усвоенного материала	- Вопросы к экзамену (приложение 1)

4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений и навыков

Экзамен

Проводится в заданный срок, согласно графику учебного процесса. Экзамен проходит в форме собеседования по билетам, в которые включаются теоретические вопросы. При выставлении оценок учитывается уровень приобретенных компетенций обучающегося. Аудиторное время, отведенное обучающемуся, на подготовку - 30 мин.

Расчетно-графическая работа

Это внеаудиторный вид самостоятельной работы обучающихся. Расчетно-графическая работа включает в себя теоретические вопросы и практические задания. Работа выполняется по вариантам, согласно последней цифре шифра и сдается на проверку. После проверки расчетно-графическая работа возвращается обучающимся для подготовки ее защите. Защита расчетно-графической работы проводится на экзаменационной сессии и является основанием для допуска к экзамену. При защите расчетно-графической работы обучающиеся должны ответить на теоретические вопросы по тематике расчетно-графической работы.

1. Экономические показатели, характеризующие предпринимательские риски.
2. Факторы, влияющие на уровень предпринимательских рисков.
3. Методики оценки рисков хозяйствующих субъектов.
4. Методы оценки предпринимательских рисков.
5. Основные направления и методы снижения предпринимательских рисков.
6. Оценка рисков с помощью методов качественного и количественного анализа рисков.
7. Оценка финансовых рисков компании.
8. Использование современных методов оценки рыночных рисков для принятия эффективных управленческих решений.
9. Основы построения системы риск-менеджмента на предприятии.
10. Анализ системы управления рисками в деятельности предприятий на территории России.
11. Коммерческий риск инновационной деятельности.
12. Основные положения современной теории рисков.
13. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска.

Практические занятия

Практические занятия - метод репродуктивного обучения, обеспечивающий связь теории и практики, содействующий выработке у обучающихся умений и навыков применения знаний, полученных на лекции и в ходе самостоятельной работы. Цель занятий - привить навыки решения задач и сформировать экономическое мышление в сфере учета и анализа рисков на транспортных предприятиях.

ВОПРОСЫ К ЭКЗАМЕНУ

Вопросы для проверки уровня обученности «ЗНАТЬ»

1. Сущность риска.
2. Что означает полная неопределенность.
3. Что означает частичная неопределенность.
4. Характерные черты рискованных ситуаций.
5. Составляющие элементы риска.
6. Функции риска.
7. Характеристики риска.
8. Перечислите риски внешней среды организации.
9. Перечислите риски макросреды.
10. Перечислите внутренние риски предприятия.
11. Виды диагностики риска.
12. Этапы диагностики риска.
13. Методы управления рисками.
14. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
15. Существенные признаки рисков.
16. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.
17. Концепция конфликта целей в организации.
18. Неопределенность, ее роль в развитии организации.
19. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.
20. Как влияет риск на эффективность управления.
21. Управленческое решение как объект управления рисками.
22. Управление рисками на индивидуальном уровне: основные характеристики объекта управления.
23. Характеристика операционного риска.
24. Характеристика финансового риска.
25. Причины операционных рисков.
26. Риски, связанные с покупательной способностью денег.
27. Риски, связанные с вложением капитала (инвестиционные риски).
28. Как делятся риски по уровню финансовых потерь.
29. Какой метод оценки риска, используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий.
30. Какой метод оценки риска, представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты.

Вопросы для проверки уровня обученности «УМЕТЬ»

1. Сформулируйте метод избегания рисков.
2. Сформулируйте метод принятия рисков на себя.
3. Сформулируйте метод предотвращения убытков.
4. Сформулируйте метод уменьшения размера убытков.
5. Сформулируйте метод страхования.

6. Сформулируйте метод самострахования.
7. Сформулируйте метод передачи рисков.
8. Сформулируйте принципы использования и комбинирования методов управления рисками.
9. Сформулируйте методологические принципы оценки рисков.
10. Использовать методические и операционные принципы оценки рисков.
11. Сформулируйте количественные методы оценки рисков.
12. Сформулируйте качественные методы оценки рисков.
13. Сформулируйте моделирование в управлении рисками.
14. Что является объектом управления в риск-менеджменте.
15. Что представляет собой анализ риска.
16. Дайте характеристику понятия кривая риска.
17. Какие показатели оценки риска могут быть использованы в условиях определенности?
18. Какой статистический показатель оценки риска, характеризующий отклонение крайних значений результата от среднего.
19. Какие есть недостатки статистических показателей оценки риска.
20. Сформулируйте понятие идентификация риска.
21. Какие риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль?
22. Как называются риски, которые практически всегда несут в себе потери?
23. Как называются риски, которые обусловлены деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией?
24. Чем измеряется величина или степень риска?
25. В чем состоит социально-экономическая функция риска?
26. Каким образом можно учитывать риск при расчете чистой приведенной стоимости?
27. Перечислите субъект управления в риск-менеджменте.
28. В чем сущность статистических методов для оценки рисков.
29. В чем смысл коэффициента вариации как критерия оценки риска.
30. В чем заключается сущность анализа безубыточности.

Проверка уровня обученности «ВЛАДЕТЬ»

1. Рассчитайте количественную оценку риска

У - ущерб в результате наступления рискового события - 4568 д.е.

Р - вероятность наступления риска – 0,3

П – планируемая прибыль – 2564 д.е.

2. Требуется выбрать вариант из имеющихся двух, связанных с реализацией продукции. При этом возможный ущерб в первом варианте в случае не реализации продукции 1-го вида – 10 млн. р., во втором варианте – 5 млн. р. Вероятность того, что 1-й вид продукции будет реализован – 0,25, а 2-й – 0,05.

3. Определить ожидаемую прибыль по мероприятию А. Исходные данные. От мероприятия А ожидается получение прибыли в сумме 30 тыс. р вероятностью 0,6.

4. Определит ожидаемую прибыль по мероприятию Б. От мероприятия Б ожидается получение прибыли в сумме 20 тыс. р. с вероятностью 0,4.

5. Определить ожидаемую прибыль по мероприятию А и по мероприятию Б, а также общую ожидаемую прибыль. Исходные данные. Имеется два варианта вложения капитала в мероприятие А и Б. От мероприятия А ожидается получение прибыли в сумме 10 тыс. р. вероятностью 0,6. От мероприятия Б ожидается получение прибыли в сумме 20 тыс. р. с вероятностью 0,4.

Оценочные средства

ПК-2. Способен проводить финансовый анализ, бюджетирование и управление денежными потоками.

Тестовые задания

1. Идентификация риска это:

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

2. Что подразумевается под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков _____

3. Что такое риск?

а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели

б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна

в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

4. Риски по уровню финансовых потерь делятся на:

а) допустимый, критический и катастрофический

б) недопустимый, допустимый и критический

в) критический, катастрофический и недопустимый

5. Определите соответствие уровня риска и финансовых потерь

1. Допустимый

2. Критический

3. Катастрофический
- а) выручка равна затратам
 - б) потеря прибыли
 - в) банкротство

6. Подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных спецификой климатических условий, а также наличием природных ресурсов:

- а) природно-климатические
- б) антропогенные
- в) социально-бытовые

7. _____ риски – такие риски, в результате которых реализации предприятию грозит потеря прибыли.

8. Рассчитайте количественную оценку риска

У - ущерб в результате наступления рискованного события - 4568 д.е.

Р - вероятность наступления риска - 0,3

П – планируемая прибыль - 2564 д.е.

9. Социально-экономическая функция риска состоит в следующем:

- а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике – отрасли деятельности, в которых риск приемлем
- б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода
- в) оба варианта верны

10. Выделите метод оценки риска, используемый в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий:

- а) имитационное моделирование
- б) вероятностный метод
- в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- г) построение дерева решений
- д) анализ чувствительности
- е) метод сценариев

11. Отметьте метод оценки риска, представляющий собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты:

- а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- б) анализ чувствительности
- в) построение дерева решений
- г) вероятностный метод
- д) метод сценариев

е) имитационное моделирование

12. Субъект управления в риск-менеджменте - это:

- а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками
- б) все варианты верны
- в) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

13. Объектом управления в риск-менеджменте выступает:

- а) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами
- б) все варианты верны
- в) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

14. «Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» — в чем смысл этой фразы?

- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- б) закона неизбежности риска
- в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

15. Выберите методы, к которым относится обучение и инструктирование персонала:

- а) методы уклонения от рисков
- б) методы компенсации рисков
- в) методы диверсификации рисков
- г) методы локализации рисков

16. Дайте определение термину «риск»:

- а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

17. Что из перечисленного относится к потерям времени?

- а) невыполнение сроков сдачи объекта
- б) потери ценных бумаг
- в) выплата штрафа
- г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
- д) уплата дополнительных налогов

18. Процесс использования механизмов уменьшения рисков называется так:

- а) диверсификация
- б) лимитирование
- в) хеджирование

19. Анализ риска подразумевает под собой следующее:

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

20. Выберите, что является принципом действия механизма диверсификации:

- а) избежание рисков
- б) разделение рисков
- в) снижение рисков

21. К этим методам относится распределение ответственности между участниками проекта:

- а) методы диверсификации рисков
- б) методы компенсации рисков
- в) методы локализации рисков
- г) методы уклонения от рисков

22. Выберите подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных техногенными катастрофами:

- а) антропогенные
- б) природно-климатические
- в) социально-бытовые

23. Отметьте подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных заболеваемостью животных и людей инфекционными заболеваниями:

- а) природно-климатические
- б) социально-бытовые
- в) антропогенные

24. Кривая риска представляет собой:

- а). Распределение вероятности потерь при заключении сделки;
- б). Графическое изображение существующих рисков и вероятностей их наступления.

25. Какие показатели оценки риска могут быть использованы в условиях определенности?

- а). Вероятностные и статистические показатели
- б). Абсолютные, относительные и средние показатели
- в). Экспертные оценки уровня риска

26. К каким методам относится прогнозирование внешней обстановки?

- а) методы компенсации рисков
- б) методы уклонения от рисков
- в) методы локализации рисков
- г) методы диверсификации рисков

27. К каким методам относится распределение риска по этапам работы?

- а) методы локализации рисков
- б) методы компенсации рисков
- в) методы уклонения от рисков
- г) методы диверсификации рисков

28. Выберите, к каким методам относится заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов:

- а) методы диверсификации рисков
- б) методы уклонения от рисков
- в) методы компенсации рисков
- г) методы локализации рисков

29. Название риска, который не зависит от состояния рынка и является спецификой конкретной организации:

- а) чистый
- б) спекулятивный
- в) несистемный
- г) системный

30. Коэффициент риска, шкалы риска и системы нормативов относятся к:

- а). Абсолютным показателям риска
- б). Относительным показателям риска
- в). Статистическим показателям риска

31. Величина коэффициента риска в пределах от 0,3 до 0,6 характеризует:

- а). Минимальный уровень риска
- б). Допустимый уровень риска
- в). Высокий уровень риска
- г). Недопустимый уровень риска

32. Ситуация, когда информация о рисковом событии существует в виде частоты (вероятности) его появления, называется:

- а). Ситуацией определенности

- б). Ситуацией риска (частичной неопределенности)
- в). Ситуацией неопределенности

33. Статистический показатель оценки риска, характеризующий отклонение крайних значений результата от среднего, называется:

- а). Дисперсией
- б). Размахом вариации
- в). Средним квадратическим отклонением

34. Дисперсия как мера риска результата представляет собой:

- а). Отношение среднего квадратического отклонения к среднему ожидаемому значению, что характеризует количество риска на единицу доходности
- б). Средневзвешенную величину из квадратных отклонений действительных результатов от средних ожидаемых, что характеризует разброс результатов относительно среднего
- в). Средневзвешенное произведение всех возможных значений результатов на вероятности их возникновения

35. Показатель, выражающий количество риска на единицу доходности и являющийся комплексным относительным показателем, который позволяет сравнивать результаты, выраженные в разных единицах измерения, называется:

- а). Дисперсией
- б). Коэффициентом вариации
- в). Средним квадратическим отклонением

36. Недостатком статистических показателей оценки риска является:

- а). Большой объем исходных данных и необходимость учета дополнительных характеристик и критериев принятия решения
- б). Ограниченность применения
- в). Сложность расчетов

37. Экспертные методы принятия рискованных решений представляют собой:

- а). Качественные оценки специалистов, позволяющие наиболее полно описать ситуацию принятия рискованного решения и рассмотреть трудно формализуемые варианты
- б). Комплекс логических и математических процедур, направленных на получение от специалистов-экспертов информации, её анализ и обобщение с целью выбора рациональных решений

38. Оптимальным количеством экспертов при проведении экспертизы, если она не является анонимной и решение вырабатывается экспертами совместно, является:

- а). 2-3 человека
- б). 5-12 человек
- в). 15-20 человек

39. Проведение экспертизы в несколько туров, определение обобщенного мнения экспертов (медианы) и обоснование радикальных мнений отдельных специалистов характеризует:

- а). Метод группировок
- б). Метод ранжировок
- в). Метод Дельфи

40. Что такое идентификация риска?

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия

б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты

41. Под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков понимается:

- а) страховой тариф
- б) страховая сумма
- в) страховая премия

42. Как называются риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль?

- а) чистыми
- б) критическими
- в) спекулятивными

43. На какие виды подразделяются риски по уровню финансовых потерь?

- а) допустимый, критический и катастрофический
- б) недопустимый, допустимый и критический
- в) критический, катастрофический и недопустимый

44. Что такое последствия риска?

- а) скорее положительными
- б) как положительными, так и отрицательными
- в) только отрицательными

45. Как называются риски, которые практически всегда несут в себе потери?

- а) критическими
- б) спекулятивными
- в) чистыми

46. В основе какой из ниже предложенных операции лежит обмен финансовыми активами или обязательствами для улучшения их структуры и снижения возможных потерь:

- а) своп
- б) хеджирование
- в) репо

47. Как называются риски, которые обусловлены деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией?

- а) внешними
- б) внутренними
- в) чистыми

48. Как называются риски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря прибыли?

- а) катастрофическими
- б) критическими
- в) допустимыми

49. Чем измеряется величина или степень риска?

- а) средним ожидаемым значением
- б) изменчивостью возможного результата
- в) оба варианта верны

50. В чем состоит социально-экономическая функция риска?

- а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике – отрасли деятельности, в которых риск приемлем
- б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода
- в) оба варианта верны

51. Каким образом можно учитывать риск при расчете чистой приведенной стоимости?

- а) в знаменателе формулы NPV посредством корректировки ставки дисконта
- б) комбинация формул NPV посредством корректировки чистых денежных потоков
- в) все варианты верны
- г) в числителе формулы NPV посредством корректировки чистых денежных потоков

52. Субъект управления в риск-менеджменте:

- а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками+
- б) все варианты верны
- в) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

53. Объект управления в риск-менеджменте:

- а) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

- б) все варианты верны
- в) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

54. «Деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» включает в себя смысл:

- а) закона неизбежности риска
- б) закона сочетания потенциальных потерь и выгод
- в) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

55. «Практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» включает в себя смысл:

- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- б) закона неизбежности риска
- в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

56. «Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» включает в себя смысл:

- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- б) закона неизбежности риска
- в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

57. Прогнозирование внешней обстановки относится к:

- а) методы компенсации рисков
- б) методы уклонения от рисков
- в) методы локализации рисков
- г) методы диверсификации рисков

58. Распределение риска по этапам работы относится к:

- а) методы локализации рисков
- б) методы компенсации рисков
- в) методы уклонения от рисков
- г) методы диверсификации рисков

59. Заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов относится к:

- а) методы диверсификации рисков
- б) методы уклонения от рисков
- в) методы компенсации рисков
- г) методы локализации рисков

60. Обучение и инструктирование персонала относится к:

- а) методы уклонения от рисков
- б) методы компенсации рисков

- в) методы диверсификации рисков
- г) методы локализации рисков

Вопросы для подготовки к тестовым заданиям

1. Что понимается под неопределенностью? Каковы ее факторы и виды?
2. Как определяется «риск» в современных экономических условиях?
3. Каким образом взаимосвязаны неопределенность и риск?
4. Каковы функции риска в экономике?
5. Назовите основные классы рисков.
6. Дайте характеристику основным видам рисков.
7. Охарактеризуйте финансовый риск, его виды, факторы.
8. Охарактеризуйте производственный риск, его виды, факторы.
9. Охарактеризуйте инвестиционный риск, его виды, факторы.
10. Охарактеризуйте процентные риски (факторы, виды, снижение рисков).
11. В чем сущность кредитных рисков (факторы, виды, снижение рисков).
12. Охарактеризуйте инфляционный риск
13. Дайте характеристику валютных рисков (факторы, виды, снижение рисков).
14. Что составляет качественный анализ риска?
15. Какова роль информации в анализе рисков?
16. Назовите источники информации.
17. Какие требования предъявляются к качеству информации?
18. Как оценить качество информации?
19. Дайте определение ряда распределения и этапов его построения.
20. Каким законам распределения можно описать эмпирическое распределение?
21. Как идентифицировать закона распределения случайной величины?
22. В чем состоит критерий согласия?
23. Что представляет кривая рисков?
24. Как оценивается риск на основе коэффициента вариации?
25. Назовите факторы ограничения риска.
26. Понятие игры с природой.
27. Что составляет предмет теории игр. Основные понятия.
28. Как анализируется экспертная информация?
29. Какова роль руководителя в принятии рискованных решений?
30. Опционы, форвардные и фьючерсные контракты
31. Оценивать риски на основе математического ожидания.
32. Проводить выбор оптимального решения с помощью доверительного интервала.
33. Выбирается оптимальное решение с помощью статистических оценок.
34. Определять объект и субъект управления рисками.
35. Планировать этапы процесса управления риском.
36. Оценивать эффективность управления рисками.
37. Выбрать приемы управления риском.
38. Применять диверсификацию.
39. Проводить страхование риска.
40. Проводить хеджирование
41. Использовать лимитирования.

42. Использовать самострахования.
43. Определять личностные факторы, влияющие на степень риска при принятии управленческих решений.
44. Определять субъективную вероятность.
45. Проводить экспертный анализ рисков.
46. Использовать алгоритм экспертного анализа рисков.
47. Использовать методы обработки информации.
48. Применять критерий крайнего пессимизма (Вальда, максимина)?
49. Охарактеризуйте критерий крайнего оптимизма (максимакса)
50. Применять Альфа-критерий Гурвица
51. Применять критерий Сэвиджа (критерий отказа от минимакса)
52. Применять критерий Лапласа (Байесово решение)
53. Осуществлять выбор критерия в зависимости от рискованных обстоятельств.
54. Применять методы эффективных решений в условиях неопределенности.
55. Осуществлять выбор решений при наличии многокритериальных альтернатив.
56. Оценивать риск ликвидности.
57. Оценивать риск активов.
58. Оценивать вероятность степени финансового риска.
59. Использовать классификацию риска.
60. Оценивать влияние фактора времени на степень риска.