

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Маланичева Наталья Николаевна
Должность: директор филиала
Дата подписания: 05.12.2023 15:47:16
Уникальный программный ключ:
94732c3d953a82d495dccc3155d3c579883fedd18

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 рисков

рабочая программа дисциплины

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация: Экономико-правовое обеспечение
экономической безопасности

Форма обучения: заочная

Нижний Новгород 2021

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

1.1. Цели и задачи дисциплины

Целью освоения учебной дисциплины «Оценка рисков» является формирование у обучающегося компетенций в соответствии с требованиями федерального государственного образовательного стандарта по специальности 38.05.01 «Экономическая безопасность» специализации «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности».

Цель изучения курса «Оценка рисков» – создание теоретической и методологической основы для овладения знаниями в области риск менеджмента, формирование представления о практических аспектах функционирования подразделений риск менеджмента на предприятиях.

Основными задачами учебной дисциплины являются формирование у студентов 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

Компетенции, формируемые в процессе изучения дисциплины	Результаты освоения учебной дисциплины
ОПК-2 способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач	Знать: - методы оценки рисков; - закономерности возникновения рисков; - экономические приемы оценки рисков;
	Уметь: - применять методы оценки рисков; - применять закономерности возникновения рисков; - применять экономические приемы оценки рисков;
	Владеть: - методами оценки рисков; - закономерностями возникновения рисков; - экономическими приемами оценки рисков;
ПК-3 способностью на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	Знать: - типы и виды рисков; - показатели, применяемые для оценки рисков; - экономическую природу рисков;
	Уметь: - анализировать типы и виды рисков; - рассчитывать показатели, применяемые для оценки рисков; - обосновывать экономическую природу рисков;

	Владеть: - навыками анализа типов и видов рисков; - показателями, применяемыми для оценки рисков; - навыками обоснования экономической природы рисков;
ПК-32 способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	Знать: - методы анализа рисков экономической безопасности; - способы оценки рисков экономической безопасности; - методы прогнозирования рисков экономической безопасности; Уметь: - применять методы анализа рисков экономической безопасности; - применять способы оценки рисков экономической безопасности; - применять методы прогнозирования рисков экономической безопасности; Владеть: - методами анализа рисков экономической безопасности; - способами оценки рисков экономической безопасности; - методами прогнозирования рисков экономической безопасности;

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Учебная дисциплина «Оценка рисков» относится к базовой части Блока Б1. Дисциплины (модули) и является обязательной для изучения.

Код дисциплины	Наименование дисциплины	Коды формируемых компетенций
Осваиваемая дисциплина		
Б1.Б.28	Оценка рисков	ОПК-2, ПК-3 ПК-32
Предшествующие дисциплины		
Б1.Б.10	Информационные системы в экономике	ОПК-2
Б1.Б.13	Страхование	ОПК-2, ПК-32
Б1.Б.23	Экономическая безопасность	ПК-32
Б1.Б.17	Рынок ценных бумаг	ОПК-2
Б1.Б.19	Мировая экономика и международные экономические отношения	ОПК-2
Б1.Б.16	Экономика организации (предприятия)	ПК-3
Б1.Б.20	Экономический анализ	ОПК-2, ПК-3
Б1.Б.24	Аудит	ПК-3
Б1.Б.11	Деньги, кредит, банки	ПК-3
Б1.В.02	Поиск и обработка экономической информации	ПК-3
Б1.В.05	Экономика отраслевых рынков	ПК-3
Б1.В.07	Безопасность предпринимательской деятельности	ПК-32
Б2.Б.01(У)	Учебная практика, практика по получению первичных профессиональных умений, в том числе первичных умений и навыков научно-исследовательской работы	ПК-3

Дисциплины, осваиваемые параллельно		
Б1.Б.30.02	Государственное регулирование национальной экономики	ОПК-2
Б1.В.09	Социальная политика в стратегии экономической безопасности	ПК-32
Б1.В.10	Экономическая безопасность регионов	ПК-32
Последующие дисциплины		
Б1.Б.30.03	Государственное регулирование инвестиционной деятельности	ОПК-2
Б1.В.ДВ.06.02	Экономический анализ защиты объектов инфраструктуры	ОПК-2
Б1.В.ДВ.08.02	Анализ хозяйственной деятельности	ПК-3
Б1.Б.30.05	Геополитические интересы России в условиях глобализации	ПК-32
Б1.Б.30.06	Финансовая безопасность национальной экономики	ПК-32
Б1.В.ДВ.07.01	Теневая экономика	ПК-32
Б1.В.ДВ.09.01	Антикоррупционная политика государства	ПК-32
Б1.В.ДВ.09.02	Государственное-частное партнерство	ПК-32
Б1.В.ДВ.11.01	Корпоративное управление и безопасность	ПК-32
Б2.Б.03(Н)	Производственная практика, научно-исследовательская работа	ПК-32
Б2.Б.04(Пд)	Производственная практика, преддипломная практика	ПК-3, ПК - 32
Б3.Б.01	Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты	ОПК-2, ПК-3 ПК-32

3. Объем дисциплины 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 на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	Всего часов по учебному плану	Курсы
		4
Общая трудоемкость дисциплины:		
- часов	288	288
- зачетных единиц	8	8
Контактная работа обучающихся с преподавателем (всего), часов	16	16
<i>из нее аудиторные занятия, всего</i>	16	16
в т.ч. лекции	6	6
практические занятия	10	10
Промежуточный контроль успеваемости, часов по учебному плану	9	9
Самостоятельная работа	263	263
В т. ч. на выполнение курсовой работы	36	36
Виды промежуточного контроля	Экз	Экз
Текущий контроль (вид, количество)	КР	КР

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 некомпетенции 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 и избежание. 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 учебно-му плану	Виды учебных занятий		
		Контактная работа (аудиторная работа)		СРС
		лекции	практические занятия	
Тема 1. Понятие риска и его природа	30	1		29
Тема 2. Риски внешней и внутренней среды	32	1	2	29
Тема 3. Диагностика рисков компании	32	1	2	29
Тема 4. Методы оценки рисков	33	2	2	29
Тема 5. Макроэкономические и политические риски	32	1	2	29
Тема 6. Риски отношений в альянсах	29			29
Тема 7. Риски, связанные с человеческим фактором	29			29
Тема 8. Операционные и финансовые риски	29			29
Тема 9. Методы управления рисками	33		2	31
Экзамен	9			
Всего	288	6	10	263

4.3. Тематика практических занятий

Тема практического занятия	Количество часов
Тема. Оценка рисков внешней и внутренней среды	2
Тема. Диагностика рисков компании	2
Тема. Методы оценки рисков	2
Тема. Макроэкономические и политические риски	2
Тема. Разработка методов управления рисками	2
Всего	10

4.4. Тематика лабораторных работ

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

4.5. Тематика курсовых работ

Тема 1. Экономические показатели, характеризующие предпринимательские риски

Тема 2. Факторы, влияющие на уровень предпринимательских рисков

Тема 3. Методики оценки рисков хозяйствующих субъектов.

Тема 4. Методы оценки предпринимательских рисков

Тема 5. Основные направления и методы снижения предпринимательских рисков

Тема 6. Оценка рисков с помощью методов качественного и количественного анализа рисков

Тема 7. Оценка финансовых рисков компании

Тема 8. Использование современных методов оценки рыночных рисков для принятия эффективных управленческих решений.

Тема 9. Основы построения системы риск-менеджмента на предприятии

Тема 10. Анализ системы управления рисками в деятельности предприятий на территории России

Тема 11. Коммерческий риск инновационной деятельности

Тема 12. Основные положения современной теории рисков

Тема 13. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска

4.6. Тематика контрольных работ

Контрольные работы учебным планом не предусмотрены.

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

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	29	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение курсовой работы. Подготовка к промежуточной аттестации
Тема 2. Риски внешней и внутренней среды	29	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение курсовой работы. Подготовка к промежуточной аттестации
Тема 3. Диагностика рисков компании	29	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение курсовой работы. Подготовка к промежуточной аттестации
Тема 4. Методы оценки рисков	29	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение курсовой работы. Подготовка к промежуточной аттестации
Тема 5. Макроэкономические и политические риски	29	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение курсовой работы. Подготовка к промежуточной аттестации
Тема 6. Риски отношений в альянсах	29	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение курсовой работы. Подготовка к промежуточной аттестации
Тема 7. Риски, связанные с человеческим фактором	29	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение курсовой работы. Подготовка к промежуточной аттестации
Тема 8. Операционные риски и финансовые риски	29	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение курсовой работы. Подготовка к промежуточной аттестации
Тема 9. Методы управления рисками	31	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Выполнение курсовой работы. Подготовка к промежуточной аттестации
Всего	263	

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

- учебная литература – библиотека филиала;
- методические рекомендации по выполнению курсовых работ;
- методические рекомендации по самостоятельному изучению теоретического материала – сайт филиала.

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

Виды оценочных средств	Количество
Текущий контроль	
Курсовая работа	1
Промежуточный контроль	
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	Охотников, И. В.	Оценка рисков : учебно-методическое пособие	Москва: РУТ (МИИТ), 2018. — 76 с. — режим доступа: https://e.lanbook.com/book/173758	Электронный ресурс
Л1.1	Донец, Л. И.	Обоснование хозяйственных решений и оценка рисков : учебное пособие	Донецк: ДонНУЭТ имени Туган-Барановского, 2019. — 260 с. — режим доступа: https://e.lanbook.com/book/166717	Электронный ресурс
7.2. Дополнительная литература				
Л2.1	А. П. Шихвердиев, Н. А. Михальченко, Е. И. Еремеев, С. П. Болотов	Оценка и страхование рисков хозяйствующих субъектов : монография	Сыктывкар: СГУ им. Питирима Сорокина, 2016. — 96 с. — режим доступа: https://e.lanbook.com/book/176958	Электронный ресурс

8. Перечень ресурсов информационно - телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины

1. Официальный сайт филиала СамГУПС в г. Нижнем Новгороде.
2. Электронная библиотечная система.
3. Поисковые системы «Яндекс», «Google» для доступа к тематическим информационным ресурсам.

9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

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 студент заполняет отчет, который защищает у преподавателя в конце занятия.

3. В рамках самостоятельной работы студент должен выполнить курсовую работу. Прежде чем выполнять задания курсовой работы, необходимо изучить теоретический материал, методические указания по выполнению работ. Выполнение и защита курсовой работы являются непременным условием для допуска к экзамену. Во время выполнения курсовой 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

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 самостоятельной работы студентов: Windows 7 и выше, Microsoft Office 2003 и выше.

Профессиональные базы данных, используемые для изучения дисциплины (свободный доступ)

Федеральный образовательный портал «Экономика Социология Менеджмент» - <http://ecsocman.hse.ru>

Базы данных официальной статистики Федеральной службы государственной статистики - <https://rosstat.gov.ru/databases>

Единый архив экономических и социологических данных http://sophist.hse.ru/data_access.shtml

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

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

Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), 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, служащие для представления учебной

информации большой аудитории: переносной экран, переносной проектор, ноутбук. Учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации, соответствующие программе учебной дисциплины - комплект плакатов и презентаций (хранится на кафедре).

11.2. Перечень лабораторного оборудования

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

**ФОНД
ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

по учебной дисциплине

ОЦЕНКА РИСКОВ

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

1.1. Перечень компетенций

- способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач (ОПК-2)
- способностью на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов (ПК-3)
- способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности (ПК-32)

1.2. Этапы формирования компетенций в процессе освоения учебной дисциплины

Наименование этапа	Содержание этапа (виды учебной работы)	Коды формируемых на этапе компетенций
Этап 1. Формирование теоретической базы знаний	Лекции, самостоятельная работа студентов с теоретической базой, практические занятия	ОПК-2, ПК-3, ПК-32
Этап 2. Формирование умений	Практические занятия	ОПК-2, ПК-3, ПК-32
Этап 3. Формирование навыков практического использования знаний и умений	Выполнение курсовой работы	ОПК-2, ПК-3, ПК-32
Этап 4. Проверка усвоенного материала	Защита курсовой работы, экзамен	ОПК-2, ПК-3, ПК-32

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	Показатели оценивания компетенций	Критерии	Способы оценки
Этап 1. Формирование теоретической базы знаний	ОПК-2 ПК-3 ПК-32	- 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 студента в обсуждении теоретических вопросов;	устный ответ

Этап 2. Формирование умений (решение задачи по образцу)	ОПК-2 ПК-3 ПК-32	- выполнение практических заданий	- успешное самостоятельное выполнение практических заданий	отчет по практическому занятию
Этап 3. Формирование навыков практического использования знаний и умений	ОПК-2 ПК-3 ПК-32	- наличие правильно выполненной курсовой работы	- курсовая работа имеет положительную рецензию и допущена к защите	курсовая работа
Этап 4. Проверка усвоенного материала	ОПК-2 ПК-3 ПК-32	- успешная защита курсовой работы; - экзамен	- ответы на все вопросы по курсовой работе; - ответы на вопросы к экзамену	устный ответ

2.2. Критерии оценивания компетенций по уровню их сформированности

Код компетенции	Уровни сформированности компетенций		
	базовый	средний	высокий
ОПК-2	Знать: - методы оценки рисков; Уметь: - применять методы оценки рисков; Владеть: - методами оценки рисков;	Знать: - закономерности возникновения рисков; Уметь: - применять закономерности возникновения рисков; Владеть: - закономерностями возникновения рисков;	Знать: - экономические приемы оценки рисков; Уметь: - применять экономические приемы оценки рисков; Владеть: - экономическими приемами оценки рисков;
ПК-3	Знать: - типы и виды рисков; Уметь: - анализировать типы и виды рисков; Владеть: - навыками анализа типов и видов рисков;	Знать: - показатели, применяемые для оценки рисков; Уметь: - рассчитывать показатели, применяемые для оценки рисков; Владеть: - показателями, применяемыми для оценки рисков;	Знать: - экономическую природу рисков; Уметь: - обосновывать экономическую природу рисков; Владеть: - навыками обоснования экономической природы рисков;
ПК-32	Знать: - методы анализа рисков экономической безопасности; Уметь: - применять методы анализа рисков экономической безопасности; Владеть: - методами анализа рисков экономической безопасности;	Знать: - способы оценки рисков экономической безопасности; Уметь: - применять способы оценки рисков экономической безопасности; Владеть: - способами оценки рисков экономической безопасности;	Знать: методы прогнозирования рисков экономической безопасности; Уметь: - применять методы прогнозирования рисков экономической безопасности; Владеть: - методами прогнозирования рисков экономической безопасности;

2.3. Шкалы оценивания формирования компетенций

а) Шкала оценивания экзамена

Шкала оценивания	Критерии оценивания
оценка «отлично»	Студент обладает глубокими и прочными знаниями программного материала; демонстрирует полное соответствие знаний, умений и навыков показателям и критериям оценивания компетенций на формируемом дисциплиной уровне. При ответе на два теоретических вопроса продемонстрировал исчерпывающее, последовательное и логически стройное изложение; правильно сформулировал понятия и закономерности по вопросам; использовал примеры из дополнительной литературы и практики; сделал вывод по излагаемому материалу. Решил задачу правильно.
оценка «хорошо»	Студент обладает достаточно полным знанием программного материала; демонстрирует полное соответствие знаний, умений и навыков показателям и критериям оценивания компетенций на формируемом дисциплиной уровне. Его ответ представляет грамотное изложение учебного материала по существу; отсутствуют существенные неточности в формулировании понятий; правильно применены теоретические положения, подтвержденные примерами; сделан вывод; два теоретических вопроса освещены полностью или один вопрос освещён полностью, а второй доводится до логического завершения при наводящих вопросах преподавателя. Решил задачу. При ответе на дополнительные вопросы допускает неточности.
оценка «удовлетворительно»	Теоретическое содержание дисциплины освоено частично, но проблемы не носят принципиального характера. Студент демонстрирует неполное соответствие знаний, умений и навыков показателям и критериям оценивания компетенций на формируемом дисциплиной уровне: допускаются значительные ошибки, проявляется отсутствие знаний по ряду вопросов. Один вопрос разобран полностью, второй начат, но не завершён до конца. Решил задачу на 50%. Затрудняется отвечать на дополнительные вопросы.
оценка «неудовлетворительно»	Студент не знает значительную часть программного материала; допустил существенные ошибки в процессе изложения; не умеет выделить главное и сделать вывод; приводит ошибочные определения; ни один вопрос не рассмотрен до конца, наводящие вопросы не помогают. Студент демонстрирует явную недостаточность или полное отсутствие знаний, умений и навыков на заданном уровне сформированности компетенции.

б) Шкала оценивания курсовой работы

Шкала оценивания	Критерии оценивания
оценка «отлично»	Проанализирована научная литература и нормативно-правовая база

	по проблематике курсовой работы; структура работы логична, материал излагается научно и доказательно; в работе проанализированы все статистические показатели, характеризующие объект исследования; выявлены причины и факторы сложившейся динамики анализируемых показателей; приведённые предложения по улучшению сложившейся ситуации дополнены и подтверждены расчетами; для повышения наглядности работы используется графический метод представления информации.
оценка «хорошо»	Проанализирована научная литература и нормативно-правовая база по проблематике курсовой работы; структура работы логична, материал излагается научно и доказательно; в работе проанализированы практически все статистические показатели, характеризующие объект исследования; выявлены причины и факторы сложившейся динамики анализируемых показателей; приведённые предложения по улучшению сложившейся ситуации, но не все дополнены и подтверждены расчетами; для повышения наглядности работы используется графический метод представления информации
оценка «удовлетворительно»	Проанализирована научная литература и нормативно-правовая база по проблематике курсовой работы; однако структура работы не логична, материал излагается бездоказательно; в работе проанализирован ряд статистических показателей, характеризующих объект исследования; не выявлены причины и факторы сложившейся динамики анализируемых показателей; приведённые предложения по улучшению сложившейся ситуации, но не все дополнены и подтверждены расчетами; графический метод представления информации имеет единичное применение.
оценка «неудовлетворительно»	Проанализирована научная литература по проблематике курсовой работы; структура работы не имеет логичного построения, материал излагается бездоказательно; в работе не проанализированы статистические показатели, характеризующие объект исследования; отсутствуют выводы и предложения по улучшению сложившейся ситуации.

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

Код компетенции	Этапы формирования компетенции	Типовые задания (оценочные средства)
ОПК-2 ПК-3 ПК-32	Этап 1. Формирование теоретической базы знаний	- устный ответ
	Этап 2. Формирование умений (решение задачи по образцу)	- практическое занятие (методические рекомендации для проведения лабораторных работ и практических занятий)
	Этап 3. Формирование навыков практического использования знаний и умений	- курсовая работа: перечень тем и заданий по вариантам (методические рекомендации по СРС)
	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 студента. Аудиторное время, отведенное студенту, на подготовку – 30 мин.

Дискуссия

При проведении дискуссии студентам для обсуждения предлагаются вопросы по теме, отведенной на практическое занятие (согласно рабочей программе учебной дисциплины).

Практические занятия

Практические занятия — метод репродуктивного обучения, обеспечивающий связь теории и практики, содействующий выработке у студентов умений и навыков применения знаний, полученных на лекции и в ходе самостоятельной работы.

При проведении практических занятий студентам предлагаются два вида задач по темам, отведенным на практическое занятие (согласно рабочей программе учебной дисциплины).

Курсовая работа

Во внеаудиторное время студент самостоятельно выполняет курсовую работу по своему варианту. Курсовая работа – вид самостоятельной письменной работы, направленный на творческое освоение общепрофессиональных и профильных профессиональных дисциплин (модулей) и выработку соответствующих профессиональных компетенций. Защита курсовой работы проходит в устной форме по вопросам, раскрываемым в курсовой работе. Перед выполнением курсовой работы студент прослушивает цикл лекций по дисциплине и участвует в практических занятиях. Студент должен изучить научную, учебную, нормативную и другую литературу. Отобрать необходимый материал; сформулировать выводы и разработать конкретные рекомендации по решению поставленной цели и задачи. Рекомендации по выполнению требований к оформлению курсовой работы находятся в методических материалах по дисциплине.

Тематика курсовых работ:

Тема 1. Экономические показатели характеризующие предпринимательские риски

Тема 2. Факторы, влияющие на уровень предпринимательских рисков

Тема 3. Методики оценки рисков хозяйствующих субъектов.

Тема 4. Методы оценки предпринимательских рисков

Тема 5. Основные направления и методы снижения предпринимательских рисков

Тема 6. Оценка рисков с помощью методов качественного и количественного анализа рисков

Тема 7. Оценка финансовых рисков компании

Тема 8. Использование современных методов оценки рыночных рисков для принятия эффективных управленческих решений.

Тема 9. Основы построения системы риск-менеджмента на предприятии

Тема 10. Анализ системы управления рисками в деятельности предприятий на территории России

Тема 11. Коммерческий риск инновационной деятельности

Тема 12. Основные положения современной теории рисков

Тема 13. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска

Вопросы к экзамену

Вопросы для проверки уровня обученности ЗНАТЬ

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

Вопросы для проверки уровня обученности УМЕТЬ

31. Оценивать риски на основе математического ожидания.
32. Проводить выбор оптимального решения с помощью доверительного интервала.
33. Выбирать 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.

Проверка уровня обученности ВЛАДЕТЬ

Студент должен владеть способностью решать задачи профессиональной деятельности в области оценки рисков.

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 значение
- 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.