

**ИНСТИТУТ ЗАКОНОВЕДЕНИЯ И УПРАВЛЕНИЯ ВПА  
КАФЕДРА МЕНЕДЖМЕНТА, УПРАВЛЕНИЯ ПЕРСОНАЛОМ И ЭКОНОМИКИ**

**МЕТОДИЧЕСКИЕ И ИНЫЕ МАТЕРИАЛЫ  
ПО ДИСЦИПЛИНЕ «РИСК - МЕНЕДЖМЕНТ»**

**Направление подготовки: Менеджмент  
(квалификация (степень): «бакалавр»)**

## СОДЕРЖАНИЕ

1. Тематические планы .....	3
2. Планы семинарских занятий.....	5
3. Планы практических занятий.....	9
4. Вопросы для самостоятельной работы студентов.....	13
5. Перечень вопросов к зачету.....	17

**ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН**  
по дисциплине «Риск- менеджмент»  
для студентов

**очной** формы обучения по направлению 38.03.02 «Менеджмент» (бакалавриат)

№ п/п	Наименование тем	Всего	Количество аудиторных часов			Сам. раб. студ. (СРС)	Формируемые компетенции	
			ауд. час.	Количество часов по видам занятий				
				Лекции	Сем. зан.			Практ. зан.
1	Основные понятия риск-менеджмента	10	4	2	2	6	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16	
2	Типы рисков	10	4	2	2	6	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16	
3	Принципы, этапы и стратегии управления рисками	16	8	4	4	8	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16	
4	Идентификация, анализ и оценка рисков	18	8	4	4	10	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16	
5	Методы управления рисками и условия их применения	18	10	4	4	2	8	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16
	Зачет							
	<b>ИТОГО</b>	<b>72</b>	<b>34</b>	<b>16</b>	<b>16</b>	<b>2</b>	<b>38</b>	

**ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН**  
по дисциплине «Риск- менеджмент»  
для студентов

**очной** формы обучения по направлению 38.03.02 «Менеджмент» (бакалавриат)

№ п/п	Наименование тем	Всего	Количество аудиторных часов			Сам. раб. студ. (СРС)	Формируемые компетенции
			ауд. час.	Количество часов по видам занятий			
				Лекции	Сем. зан.		
1	Основные понятия риск-менеджмента	10	2	1	1	8	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16
2	Типы рисков	12				12	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16
3	Принципы, этапы и стратегии управления рисками	17	3	2	1	14	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16
4	Идентификация, анализ и оценка рисков	16	2		2	14	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16
5	Методы управления рисками и условия их применения	17	3	1	1	14	ОК-7; ПК-4; ПК-9; ПК-15; ПК-16
	Зачет						
	<b>ИТОГО</b>	<b>72</b>	<b>10</b>	<b>4</b>	<b>5</b>	<b>62</b>	

## ПЛАНЫ СЕМИНАРСКИХ ЗАНЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ «РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ»

### Рекомендуемая литература по курсу:

#### Основная.

Буянский С.Г. Корпоративное управление, комплаенс и риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие для магистрантов/ С.Г. Буянский, Ю.В. Трунцевский— Электрон. текстовые данные.— М.: Русайнс, 2016.— 342 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/61620.html>.— ЭБС «IPRbooks».

#### Дополнительная.

1.Анисимов Е.Г. Экономический и таможенный риск-менеджмент [Электронный ресурс]: монография/ Е.Г. Анисимов, В.Г. Анисимов— Электрон. текстовые данные.— М.: Российская таможенная академия, 2015.— 180 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/69854.html>.— ЭБС «IPRbooks».

2.Иванов А.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие/ А.А. Иванов, С.Я. Олейников, С.А. Бочаров— Электрон. текстовые данные.— М.: Евразийский открытый институт, 2011.— 304 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10817.html>.— ЭБС «IPRbooks».

3.Пасько Е.А. Риск-менеджмент в корпоративном бизнесе [Электронный ресурс]: курс лекций на английском языке/ Е.А. Пасько— Электрон. текстовые данные.— Ставрополь: Северо-Кавказский федеральный университет, 2016.— 110 с. Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/69431.html>.— ЭБС «IPRbooks».

4.Слепухина Ю.Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Ю.Э. Слепухина— Электрон. текстовые данные.— Екатеринбург: Уральский федеральный университет, 2015.— 216 с. Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/68289.html>.— ЭБС «IPRbooks».

5.Ефремов И.В. Техногенные системы и экологический риск [Электронный ресурс]: практикум/ И.В. Ефремов, Н.Н. Рахимова— Электрон. текстовые данные.— Оренбург: Оренбургский государственный университет, ЭБС АСВ, 2015.— 174 с. Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/54166.html>.— ЭБС «IPRbooks».

6.Ефремов И.В. Техногенные системы и экологический риск [Электронный ресурс]: учебное пособие/ И.В. Ефремов, Н.Н. Рахимова— Электрон. текстовые данные.— Оренбург: Оренбургский государственный университет, ЭБС АСВ, 2016.— 171 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/61417.html>.— ЭБС «IPRbooks»

7.Надежность технических систем и техногенный риск [Электронный ресурс]: учебное пособие/ — Электрон. текстовые данные.— Воронеж: Воронежский государственный архитектурно-строительный университет, ЭБС

АСВ, 2013.— 147 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/23110.html>.— ЭБС «IPRbooks».

8.Шевцова Ю.В. Байесовы технологии. Их реализация в программной среде Hugin и применение в операционном риск-менеджменте [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Ю.В. Шевцова— Электрон. текстовые данные.— Новосибирск: Сибирский государственный университет телекоммуникаций и информатики, 2016.— 90 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/69229.html>.— ЭБС «IPRbooks».

9.Шевцова Ю.В. Байесовы технологии. Их реализация в программной среде Hugin и применение в операционном риск-менеджменте [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Ю.В. Шевцова— Электрон. текстовые данные.— Новосибирск: Сибирский государственный университет телекоммуникаций и информатики, 2010.— 77 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/54760.html>.— ЭБС «IPRbooks».

10.Лямин Л.В. Применение технологий электронного банкинга. Риск-ориентированный подход [Электронный ресурс]/ Л.В. Лямин— Электрон. текстовые данные.— М.: ЦИПСИР, 2011.— 336 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/9035.html>.— ЭБС «IPRbooks»

### **Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».**

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

2. <http://www.ts-ru.com> - Электронный журнал по менеджменту.

3.<http://www.cfin.ru> - Сайт «Корпоративный менеджмент».

4.<http://www.allbest.ru/libraries.htm> - Огромный каталог электронных библиотек.

5.<http://www.aup.ru/management/> - Административно-управленческий портал.

**Тема 1. Основные понятия риск-менеджмента – 2 ч.  
(для заочной формы обучения – 1 ч.)**

***Вопросы:***

1. Понятие опасности, источники её возникновения.
2. Определения угрозы, вызова, риска, неопределенности, ущерба, управления рисками (риск-менеджмента).
3. Функции риска.

**Тема 2. Типы рисков – 2 ч.  
(для заочной формы обучения аудиторных часов не предусмотрено тематическим планом)**

***Вопросы:***

1. Систематизация типов рисков, в частности их распределение по масштабу своего проявления и влияния на экономических агентов.
2. Классификация рисков по времени возникновения, характеру учета, сфере возникновения, характеру последствий, по причинам возникновения и числу подвергающихся риску объектов.

**Тема 3. Принципы, этапы и стратегии управления рисками – 4 ч.  
(для заочной формы обучения – 1 ч.)**

***Вопросы:***

1. Методические основы управления рисками как компоненты подсистемы разработки и реализации управленческих решений.
2. Место управления рисками в процессе реализации управленческого решения и элементы процесса разработки и принятия управленческого решения.
3. Роль стратегии в управлении рисками. Вопросы взаимосвязи стратегического управления организацией и управления рисками.
4. Стратегии управления рисками.
5. Принципы и правила управления рисками.

**Тема 4. Идентификация, анализ и оценка рисков- 4 ч.  
(для заочной формы обучения – 2 ч.)**

***Вопросы:***

1. Процесс идентификации и способы анализа и оценки рисков.
2. Показатели оценки риска: вероятность, математическое ожидание, дисперсия.
3. Оценка риска инвестиционного проекта.
4. Определение и анализ рисков: SWOT- анализ, STEP-анализ.

**Тема 5. Методы управления рисками и условия их применения– 4 ч.  
(для заочной формы обучения – 1 ч.)**

***Вопросы:***

1. Группы методов управления: распределения рисков, диссипации риска и его отличия от метода распределения рисков, диверсификации рисков, возможные варианты диверсификации, лимитирование (ограничение), локализации источников риска, компенсации рисков, страхования рисков через образование специального фонда средств и его использование.
2. Страхование рисков и хеджирование как эффективный способ снижения риска неблагоприятного изменения ценовой конъюнктуры с помощью заключения срочных контрактов (фьючерсов и опционов).
3. Стратегический риск-менеджмент.
4. Страхование рисков.
5. Аутсорсинг в управлении рисками.
6. Управление производственными и коммерческими рисками в интегрированных компаниях.



## ПЛАНЫ ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ «ЭКОНОМИЧЕСКАЯ ТЕОРИЯ»

### Практическое занятие 1 (2 часа) (для заочной формы обучения – 1 ч.)

#### *Тема 5. Методы управления рисками и условия их применения.*

*Цели занятия:*

- 1) закрепить теоретические знания по теме «Методы управления рисками и условия их применения».
- 2) научиться оценивать возможные риски, освоить методику принятия управленческих решений.

#### **Задача №1.**

Оценить степень риска предприятия; предложить мероприятия для стабилизации деятельности предприятия.

Показатель	2005г.	2006г.
1. Оборотные средства	258,9	245,4
2. Материалы и продукты питания	14,6	12,6
3. МБП	19,6	18,6
4. Текущая задолженность	55,7	64,6
5. Уставный капитал	146,3	146,3
6. Паевой капитал	445,5	415,5
7. Дополнительно вложенный капитал	22,9	22,3
8. Резервный капитал	-	-
9. Объем продаж	45,4	58,6
10. Цена за ед.	220,1	159,6
11. Прибыль от реализации ОПФ	44,3	440,3
12. Необоротные активы	153,3	44,5
13. Векселя полученные	99,3	87,6
14. Дебиторская задолженность за товары, работы, услуги	124,3	55,6
15. Дебиторская задолженность по расчетам	22,4	33,3
16. Текущие финансовые инвестиции	18,3	12,1
17. Расходы будущих периодов	28,6	14,8

R=0...1 – невозможность выполнять обязательства и нормально функционировать.

R=1...30 – высокая степень риска выхода на рынок с новым товаром.

R=31...55 – умеренно высокая степень риска выхода на рынок с новым товаром.

R=56...76 – умеренно низкая степень риска выхода на рынок с новым товаром с минимальными затратами.

R=77...100 – низкая степень риска выхода на рынок с новым товаром с минимальными затратами и быстрой окупаемостью.

### **Задача №2.**

Провести оценку риска двух инвестиционных проектов.

Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 150 тыс. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 16,7 тыс. руб.

Для второго проекта с вероятностью 0,6 можно получить прибыль 180 тыс. руб. и с вероятностью 0,4 потерять 20,0 тыс. руб.

Какой проект выбрать?

### **Задача №3.**

На предприятии свободные денежные средства составляют 50 млн. руб. Имеются следующие возможности для их использования:

1) разместить на банковском депозите под 25% годовых;

2) реализовать проект по техническому перевооружению производства.

Стоимость проекта 10 млн. руб., а его реализация позволит получить ежегодную чистую прибыль в размере 5 млн. руб.;

3) приобрести акции надежного эмитента на сумму 25 млн. руб.

Ежегодные дивиденды в сумме составят 7,6 млн. руб.;

4) участвовать в совместном проекте с другим предприятием, размер

участия – 20 млн. руб., ожидаемый ежегодный доход составит 5 млн. руб.;

5) приобрести облигации государственного займа на сумму 15 млн.

руб., ежегодный купонный доход составит сумму 3 млн. руб.

Требуется определить оптимальную структуру инвестиционного портфеля, обеспечивающего получение максимального дохода.

Риск по вариантам оценивается экспертами следующим образом:

1) банковский депозит 0,20;

2) техническое перевооружение 0,32;

3) акции стороннего эмитента 0,15;

4) участие в совместном проекте 0,18;

5) государственные облигации 0,05.

#### **Задача №4.**

Инвестиции в бизнес составили 500 тыс. рублей.

Ожидаемые доходы ( $CF_i$ ) за 5 лет составят:

2017 год – 100 тыс. рублей;

2018 год – 150 тыс. рублей;

2019 год – 200 тыс. рублей.

2020 год – 250 тыс. рублей;

2021 год – 300 тыс. рублей.

Ставка дисконтирования 20%.

Обосновать целесообразность проекта и рассчитать:

1. Чистый дисконтированный доход (NPV) за 5 лет;
2. Индекс рентабельности инвестиций (PI);
3. Сроки окупаемости простой и дисконтированный;
4. Внутреннюю норму доходности (IRR).

#### **Задача №5.**

Определите целесообразность замены старого оборудования новым, если остаточная стоимость старого оборудования 500 тыс. руб.

Срок службы остался 2 года.

Ликвидационная стоимость – 200 тыс. руб.

Новое оборудование:

– цена – 2,4 млн. руб.;

– нормативный срок службы – 6 лет;

– ликвидационная стоимость – 500 тыс. руб.

При использовании старого оборудования можно получать прибыль в размере 300 тыс. руб. в течение 6 лет.

При использовании нового оборудования П1 = 700 тыс. руб., П2 = 800 тыс. руб., П3 = 900 тыс. руб., П4 = 900 тыс. руб., П5 = 900 тыс. руб., П6 = 900 тыс. руб.

Норма дисконта – 15%.

Как изменятся показатели эффективности, если норма дисконта увеличится в 2 раза.

#### **Задача №6.**

ООО «СтройМАКС» выпускает отделочные стройматериалы. Руководство компании обратилось в консалтинговую фирму с целью изучения рынка сбыта новой продукции. Исследования предполагаемого спроса на продукцию представлены в табл.

Спрос на продукцию, тыс.шт.	15	25	35	45	55
Вероятность	0,1	0,1	0,3	0,3	0,2

Доход при реализации новых видов стройматериалов составит 7 руб. за штуку.

Если продукция не будет продаваться, убытки составят 4 руб. за единицу продукции.

Если предприятие не будет удовлетворять спрос, убытки по неудовлетворенному спросу составят 1 руб. за штуку (для поддержания репутации фирмы).

Необходимо определить оптимальный объем производства новых видов отделочных стройматериалов ООО «СтройМАКС».

При расчете учитывать, что методом экспертных оценок был установлен вес для min значения спроса на продукции равным 0,45, а для max спроса – 0,55.

### Задача №7.

Три логистическо-транспортные компании обратились к консультационной фирме с просьбой определить возможную прибыль каждой из них в том случае, если они объединятся.

После предоставления транспортными компаниями всей необходимой информации и проведения расчетов удалось установить, что:

$I_1 = V(1) = 500$  тыс. руб. – прибыль, которую стабильно получает первая компания;

$I_2 = V(2) = 600$  тыс. руб. – прибыль, которую стабильно получает вторая компания;

$I_3 = V(3) = 800$  тыс. руб. – прибыль, которую стабильно получает третья компания.

Также расчеты показали, что:

– при объединении первой и второй компании их совместная прибыль составит  $I_{1,2} = V(1,2) = 1200$  тыс. руб.,

– при объединении первой и третьей компании их совместная прибыль составит  $I_{1,3} = V(1,3) = 1300$  тыс. руб.,

– при объединении второй и третьей компании их совместная прибыль составит  $I_{2,3} = V(2,3) = 1900$  тыс. руб.,

– при объединении первой, второй и третьей компании их совместная прибыль составит  $I_{1,2,3} = V(1,2,3) = 2400$  тыс.руб.

Определить, выгодно ли компаниям объединить усилия и на каких условиях.

# **ВОПРОСЫ ДЛЯ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ**

## **по дисциплине «Риск-менеджмент»**

### **Тема 1. Основные понятия риск-менеджмента.**

1. Цели, задачи и содержание дисциплины.
2. Угрозы, вызов, риск.
3. Ущерб.
4. Безопасность и ее виды.
5. Понятие неопределенности и риска. Признаки рискованной ситуации.
6. Факторы, функции и формы проявления риска.
7. Источник риска. Событие. Последствия риска.
8. Вероятность наступления риска.
9. Владелец риска.
10. Риск-аппетит.
11. Профессиональный стандарт «Риск-менеджмент».

### **Тема 2. Типы рисков.**

1. Признаки разделения рисков на типы.
2. Риски по источнику возникновения и последствиям.
3. Риски по сфере, времени и факторам возникновения и виду учета.
4. Предпринимательские, коммерческие и финансовые риски.
5. Особенности предпринимательского, хозяйственного, экономического риска.
6. Финансовые риски.
7. Кадровые риски.

### **Тема 3. Принципы, этапы и стратегии управления рисками.**

1. Логическая система управления рисками и организационные вопросы управления рисками.
2. Правила управления рисками. Требования к информационному обеспечению управления рисками в организации.
3. Операциональная теория управления риском.
4. Принципы управления рисками.
5. Этапы риск-менеджмента.
6. Модель бизнес-процесса риск-менеджмента организации.
7. Взаимодействие стадий процесса риск-менеджмента.
8. Функции управления рисками.
9. Анализ стандартов риск-менеджмента.
10. Стратегическое управление рисками.
11. Виды стратегий управления рисками.

- 12.Этапы контроллинга управления рисками.
- 13.Информационное обеспечение управления рисками.

#### **Тема 4. Идентификация, анализ и оценка рисков.**

- 1.Регистрация рисков.
- 2.Способы идентификации: ретроспективный анализ деятельности организации; изучение опыта предшествующих исследований риска; ретроспективный анализ деятельности аналогичных организаций; исследование текущей ситуации с участием самых заинтересованных сторон и экспертов; использование контрольных перечней рисков, характерных для отрасли, организации, технологии, региона, рынка; анализ карт технологических процессов; мозговая атака; изучение статистики аварий.
- 3.Методы анализа риска.
- 4.Прямые и косвенные показатели риска.
- 5.Качественные методы анализа риска: голландский подход, принцип ALARA, экспертные подходы.
- 6.Рейтинг как способ качественной оценки риска в какой-либо области деятельности на основе формализации экспертных методов.
- 7.Проведение рейтинговой оценки на основе ранкинга.
- 8.Ранжирование и методы его осуществления.
- 9.Мягкая рейтинговая оценка. Непосредственное ранжирование.
- 10.Сравнение качественных методов оценки риска.

#### **Тема 5. Методы управления рисками и условия их применения.**

- 1.Оперативное управление рисками.
- 2.Методы управления рисками: превентивные методы (способы предотвращения рисков); методы минимизации (снижения) рисков, их последствий.
- 3.Распределение; лимитирование; самострахование; хеджирование.
- 4.Аутсорсинг в управлении рисками.
- 5.Управление производственными и коммерческими рисками в интегрированных компаниях.

## Тест для подготовки к зачету.

Таблица для ответов

Номер вопроса	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
Вариант ответа										

1.Выявление факторов риска, этапов и работ, при выполнении которых риск возникает установление потенциальных областей риска идентификация рисков - это:

- А. количественный анализ риска
- Б. вероятностный анализ риска
- В. качественный анализ риска
- Г. статистический анализ риска

2.Если при реализации проекта весьма вероятна полная потеря прибыли, риск считается:

- А. экологическим
- Б. критическим
- В. специфическим
- Г. катастрофическим
- Д. систематическим

3. Инвестиционный риск – это:

- А. возможность того, что реальный будущий доход будет отличаться от ожидаемого
- Б. возможная потеря, вызванная наступлением неблагоприятных событий
- Г. нет верного ответа
- Д. оценка возможности возникновения неблагоприятных последствий

4. Метод оценки рисков, состоящий в измерении влияния возможных отклонений отдельных параметров проекта от расчетных значений на конечные показатели ценности проекта – это:

- А. интегрирование
- Б. элиминирование
- В. анализ чувствительности
- Г. дифференциация

5. Верно ли утверждение, что диверсификация - это это расширение сферы деятельности фирмы на различных направлениях для минимизации рисков.

- А. верно
- Б. неверно

6. Для заданного количества ценных бумаг портфеля найти такую их комбинацию, чтобы риск получился минимально возможным.

- А. нельзя, поскольку риск распадается на систематический и несистематический
- Б. нельзя, так как это противоречит теореме о границе эффективных портфелей
- В. можно, и таких комбинаций существует бесконечно много
- Г. можно, и существует единственная подобная комбинация

7. Инвестиционные риски классифицируют по следующим признакам:

- А. по формам инвестирования
- Б. по источникам возникновения
- В. по сферам проявления
- Г. все ответы верны

8. К внешним признакам инвестиционного проектирования относятся:

- А. возможность ухудшения политической ситуации, риск неблагоприятных социально-политических изменений в стране или регионе
- Б. неполнота или неточность проектной документации (затраты, сроки реализации проекта, параметры техники и технологии)
- В. производственно-технологический риск (аварии и отказы оборудования, производственный брак и т.п.)
- Г. риски, связанные с нестабильностью экономического законодательства и текущей экономической ситуации, условий инвестирования и использования прибыли

9. К методам количественной оценки рисков относится

- А. Метод Делфи
- Б. Анализ безубыточности
- В. Экспертный метод
- Г. Метод аналогий

10. Какие методы оценки риска относятся к аналитическим?

- А. Анализ чувствительности
- Б. Метод экспертных оценок
- В. Метод сценариев
- Г. Метод аналогий
- Д. Метод корректировки параметров



## Перечень вопросов для подготовки к зачету

### по курсу «Риск-менеджмент».

1. Понятие опасности, источники её возникновения. Определения угрозы, вызова, риска, неопределенности, ущерба, управления рисками (риск-менеджмента).

2. Функции риска.

3. Признаки рискованной ситуации. Факторы, функции и формы проявления риска. Источник риска. Событие. Последствия риска. Вероятность наступления риска. Владелец риска. Риск-аппетит.

4. Риски по источнику возникновения и последствиям.

5. Риски по сфере, времени и факторам возникновения и виду учета.

6. Предпринимательские, коммерческие и финансовые риски.

7. Кадровые риски.

8. Методические основы управления рисками как компоненты подсистемы разработки и реализации управленческих решений. Место управления рисками в процессе реализации управленческого решения и элементы процесса разработки и принятия управленческого решения.

9. Роль стратегии в управлении рисками. Вопросы взаимосвязи стратегического управления организацией и управления рисками.

10. Стратегии управления рисками.

11. Требования к информационному обеспечению управления рисками в организации.

12. Принципы и правила управления рисками.

13. Операциональная теория управления риском.

14. Этапы риск-менеджмента. Модель бизнес-процесса риск-менеджмента организации. Взаимодействие стадий процесса риск-менеджмента. Функции управления рисками.

15. Стратегическое управление рисками. Виды стратегий управления рисками.

16. Этапы контроллинга управления рисками.

17. Способы идентификации: ретроспективный анализ деятельности организации; изучение опыта предшествующих исследований риска; ретроспективный анализ деятельности аналогичных организаций; исследование текущей ситуации с участием самых заинтересованных сторон и экспертов; использование контрольных перечней рисков, характерных для отрасли, 11 организации, технологии, региона, рынка; анализ карт технологических процессов; мозговая атака; изучение статистики аварий.

18. Определение и анализ рисков: SWOT-анализ, STEP-анализ.

19. Оценка рисков: кривая распределения вероятностей потерь.

20. Способы оценки рисков: статистические; экспертные; расчетно-аналитические; аналоговые.

21. Прямые и косвенные показатели риска. Качественные методы анализа риска: голландский подход, принцип ALARA, экспертные подходы.

22.Рейтинг как способ качественной оценки риска в какой-либо области деятельности на основе формализации экспертных методов. Проведение рейтинговой оценки на основе ранжирования. Ранжирование и методы его осуществления. Мягкая рейтинговая оценка. Непосредственное ранжирование.

23.Количественные методы оценки риска: статистические методы (методология VAR, измерение риска в нефинансовых компаниях), методы теории игр.

24.Оценка проектных рисков.

25.Матрица вероятности/потерь.

26.Группы методов управления: распределения рисков, диссипации риска и его отличия от метода распределения рисков, диверсификации рисков, возможные варианты диверсификации, лимитирование (ограничение), локализации источников риска, компенсации рисков, страхования рисков через образование специального фонда средств и его использование.

27.Страхование рисков и хеджирование как эффективный способ снижения риска неблагоприятного изменения ценовой конъюнктуры с помощью заключения срочных контрактов (фьючерсов и опционов).

28.Методика управления производственными и коммерческими рисками в холдинговых компаниях.

29.Роль стратегии аутсорсинга в управлении рисками.

30.Факторы риска в системно-интеграционной теории предприятия.

31.Феномен риска в инновационной деятельности предприятия.

32.Формирование институциональной среды риск-менеджмента.

33.Функция полезности Неймана-Моргенштерна.

34.Государственное регулирование рисков.

35.Человеческий фактор в управлении рисками. Личностные факторы, влияющие на степень риска при принятии управленческих решений.

36.Экологические риски.

37.Информационные риски.

38.Влияние факторов рыночного равновесия на изменение экономического риска.

39.Возникновение рисков при постановке миссии и целей предприятия.

40.Портфель Марковица.

*Методические и иные материалы по дисциплине «Риск-менеджмент» рассмотрены и утверждены на заседании кафедры менеджмента, управления персоналом и экономики 25.08.2017, протокол № 1.*