

Министерство науки и высшего образования
Российской Федерации

Федеральное государственное бюджетное
образовательное учреждение высшего образования
«Донецкий государственный университет»

Экономический факультет
Кафедра экономики предприятия

УТВЕРЖДАЮ
проректор

_____ П. А. Машаров
«17» апреля 2025 г.
МП

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
«УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ»**

| | |
|----------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|
| Укрупненная группа направлений подготовки | 38.00.00 Экономика и управление |
| Программа высшего образования | Программа специалитета |
| Специальность | 38.05.01 Экономическая безопасность |
| Специализация | Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности |
| Квалификация | Экономист |
| Форма обучения | Очная |

Рабочая программа может быть адаптирована для лиц
с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Донецк 2025

Рабочая программа дисциплины **«Управление рисками»** для обучающихся по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность (специализация: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности), составлена на основании Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования – специалитет по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 14 апреля 2021 г. № 293 (с изм. и доп.), Порядка организации и осуществления образовательной деятельности по образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры, утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 06 апреля 2021 г. № 245 (с изм. и доп.), в соответствии с учебным планом, утвержденным Ученым советом ФГБОУ ВО «ДонГУ» для набора 2025 года.

Разработчик:

доцент кафедры экономики предприятия
канд. экон. наук, доц.

А.Л.Тофан

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры экономики предприятия
Протокол от 11.04.2025 г. № 9

Заведующий кафедрой

Я. С. Давлианидзе

СОГЛАСОВАНО:

Декан экономического факультета
16.04.2025 г.

Ю. Н. Полшков

Учебно-методическая комиссия экономического факультета
Протокол от 16.04.2025 г. № 8
Председатель

Е. Н. Стрелина

Руководитель основной образовательной
программы:

канд. экон. наук, доц.
11.04.2025 г.

Я. С. Давлианидзе

1. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

1.1. Требования к предварительной подготовке обучающихся, предшествующие и сопутствующие дисциплины, на которых основывается изучение данной:

Дисциплины программы специалитета: «Экономическая теория», «Микроэкономика», «Макроэкономика», «Экономика организации (предприятия)», «Статистика», «Мировая экономика», «Менеджмент», «Бухгалтерский учет», «Деньги, кредит, банки», «Аудит», «Экономическая безопасность», «Налоги и налогообложение», «Налоги и налогообложение», «Планирование и прогнозирование», «Проектный анализ», «Экономический анализ», «Управление конкурентоспособностью», «Экономическая диагностика».

Дисциплины, курсовые работы и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее:

«Моделирование экономической безопасности»; междисциплинарная курсовая работа, производственная практика: практика по профилю профессиональной деятельности; производственная практика: преддипломная; выпускная квалификационная работа.

2. ОПИСАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

2.1. Общая характеристика

| Наименование показателя | Значение показателя |
|-------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Название образовательной программы | 38.05.01 Экономическая безопасность (Специализация: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности) |
| Шифр и название в соответствии с учебным планом | Б 1.Б.М6.18 «Управление рисками» |
| Часть образовательной программы | Базовая часть: общеспециальный модуль |
| Количество зачетных единиц / всего часов | 4/144 |

2.2. Распределение часов по формам и периодам обучения

| Форма обучения | курс | семестр | Общее количество часов | | | | | Форма контроля |
|----------------|------|---------|------------------------|--------------|--------------|-----------------------------------|-------|----------------|
| | | | лекционных | лабораторных | практических | самостоятельной работы + контроль | всего | |
| Очная | 4 | 8 | 28 | 14 | 28 | 74 | 144 | Экзамен |
| Заочная | 4 | 8 | 6 | 4 | 4 | 130 | 144 | Экзамен |

3. ЦЕЛИ ДИСЦИПЛИНЫ

Формирование у студентов современного экономического мышления и системы специальных знаний в отрасли диагностики и моделирования экономических процессов в условиях риска, приобретение навыков принятия управленческих решений в ситуациях, связанных с риском на основе использования экономическо-математических и статистических методов.

4. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ КОМПОНЕНТА ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ, ИХ ИНДИКАТОРЫ И ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ

4.1. Компетенции

Тип задач профессиональной деятельности: организационно-управленческий.

ПК-4. Способен планировать, организовывать и контролировать текущие и перспективные мероприятия по обеспечению экономической безопасности в организации, управлять рисками организации, руководить службами и подразделениями экономической безопасности предприятий и организаций.

4.2. Индикаторы компетенций

| Компетенции | Индикаторы | Результаты обучения |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ПК-4. Способен планировать, организовывать и контролировать текущие и перспективные мероприятия по обеспечению экономической безопасности в организации, управлять рисками организации, руководить службами и подразделениями экономической безопасности предприятий и организаций | ПК-4.2. Осуществляет построение, методическое обеспечение, поддержание, стратегическое регулирование и управление системой управления рисками организации | ПК-4.2.1. Знает основы разработки стандартов организации, методических и нормативных документов в сфере обеспечения функционирования и координации процесса управления рисками |
| | | ПК-4.2.2. Знает основы разработки методологических основ и формирование стандартов стратегического регулирования процесса управления рисками |
| | | ПК-4.2.3. Умеет формировать методологические основы интегральной системы управления рисками, формирование основных принципов разработки локальных нормативных актов по управлению рисками на уровне крупных организаций и подразделений |
| | | ПК-4.2.4. Умеет осуществлять консультирование по вопросам управления рисками в организации |
| | | ПК-4.2.5. Умеет формировать методологические основы интегральной системы управления рисками, формирование основных принципов разработки локальных нормативных актов по управлению рисками на уровне крупных организаций и подразделений |

5. ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ «УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ»

| Тема | Краткое содержание темы |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Раздел 1. Теоретические основы экономической безопасности субъектов экономики в рискованной среде | |
| Тема 1. Понятия риска и неопределенности. Классификация рисков | Риск и неопределенность – взаимосвязь и различие понятий. Функции риска в экономике. Классификация и характеристика рисков. Риски инвестиционного проекта. |
| Тема 2. Основные положения современной теории рисков | Эволюция исследования неопределенности и риска. Аксиомы теории риска. Случайность как причина риска. Концепция «риск-доходность». |

| | |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Тема 3. Типология решений и критерии выбора в рискованных ситуациях | Характеристика отношения индивидов к риску. Индивиды, не склонные к риску или противники риска (risk-aversers); нейтральные к риску (risk-neutrals) и склонные к риску (risk-takers). Модель выбора индивида в условиях неопределенности. Функция полезности дохода |
| Тема 4. Риск и неопределенность при информатизации бизнеса | Информатизация бизнеса. Специфика ИТ-отрасли. Классификация рисков в ИТ-проектах. Формулировка риска (по MSF). Планирование и идентификация рисков. Процесс выявления рисков (по MSF). Количественная и качественная оценка рисков ИТ-проектов |
| Тема 5. Стандарты и методологии управления рисками | Стандарт. Методология. Классификация стандартов управления рисками. Методология PMBoK (Project Management Body of Knowledge). Риски при использовании методологий. Риски в жизненном цикле продукта. Метрики качества. Влияние изменений на риски проектов. Аудит как средство управления рисками. |
| Тема 6. Риски в аутсорсинге | Аутсорсинг. Виды аутсорсинга. Риски и выгоды от использования аутсорсинга. Методы управления рисками аутсорсинга. |
| Раздел 2. Внешние предпринимательские риски и методы управления ими в системе экономической безопасности | |
| Тема 7. Управление рыночными рисками | Понятие рыночного риска. Классификация рыночных рисков. Портфельный подход к системе управления рисками. Тактический и стратегический риск-менеджмент. Измерение риска. Доходность и волатильность. Модель оценки капитальных активов (CAPM). Концепция стоимостной меры риска (VaR). |
| Тема 8. Управление кредитными рисками | Понятие кредитного риска. Классификация кредитных рисков. Финансовые институты и инструменты, подверженные кредитному риску. Показатели кредитного риска. Кредитное событие. Классический анализ кредитоспособности заемщика. Понятие кредитного рейтинга. Модели оценки кредитоспособности: Z-модель Альтмана, модель ZETA. |
| Тема 9. Методы оценки рисков | Статистические методы исследования и оценки рисков: вероятность, мат. ожидание, дисперсия, среднеквадратическое отклонение, коэффициент вариации. Закон нормального распределения вероятностей. Правило «трех сигм». Метод экспертных оценок. Метод аналогий. Ожидаемая полезность и теория риска Бернулли. Шкалы полезности. Функция полезности фон Неймана-Моргенштерна. |
| Тема 10. Управление рисками | Управление рисками в системе менеджмента предприятия. Объект и субъект управления рисками. Основные задачи при управлении рисками. Принципы и правила управления рисками. Этапы процесса управления риском: выявление (идентификация) риска, оценка риска, принятие решений, контроль риска. Информационное обеспечение процесса управления рисками. Методы управления рисками: диверсификация, страхование, хеджирование. |
| Тема 11. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска | Имитационная модель оценки риска. Анализ чувствительности результатов проекта к изменению условий его реализации. Метод корректировки на риск денежного потока инвестиционного проекта. Метод корректировки на риск коэффициента дисконтирования инвестиционного проекта. |
| Тема 12. Оценка риска и принятие решений в условиях неопределенности | Критерии оценки риска при отсутствии данных о вероятности возможных исходов. Понятие субъективной вероятности. Критерии принятия решений в условиях неопределенности: критерий крайнего пессимизма (Вальда, максимина), критерий крайнего оптимизма (максимакса), альфа-критерий Гурвица, критерий Сэвиджа (критерий отказа от минимакса), критерий Лапласа (Байесово решение). Выбор критерия в зависимости от рискованных обстоятельств |

6. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1. Форма обучения – очная, курс – 4, семестр – 8

| Наименования содержательных модулей и тем | Количество часов | | | | |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | Лекц. | Лабор. | Практ. | СРС+К | Всего |
| Раздел 1 | | | | | |
| <i>Теоретические основы экономической безопасности субъектов экономики в рискованной среде</i> | | | | | |
| Тема 1. Понятия риска и неопределенности. Классификация рисков | 2 | 2 | 2 | 6 | 12 |
| Тема 2. Основные положения современной теории рисков | 2 | 0 | 0 | 6 | 8 |
| Тема 3. Типология решений и критерии выбора в рискованных ситуациях | 2 | 1 | 2 | 6 | 11 |
| Тема 4. Риск и неопределенность при информатизации бизнеса | 2 | 1 | 2 | 6 | 11 |
| Тема 5. Стандарты и методологии управления рисками | 2 | 0 | 2 | 6 | 10 |
| Тема 6. Риски в аутсорсинге | 2 | 2 | 2 | 6 | 12 |
| Итого по разделу 1 | 12 | 6 | 10 | 36 | 64 |
| Раздел 2. Внешние предпринимательские риски и методы управления ими в системе функционирования предприятий | | | | | |
| Тема 7. Управление рыночными рисками | 4 | 2 | 4 | 6 | 16 |
| Тема 8. Управление кредитными рисками | 2 | 0 | 2 | 6 | 10 |
| Тема 9. Методы оценки рисков | 4 | 2 | 4 | 8 | 18 |
| Тема 10. Управление рисками | 2 | 0 | 2 | 6 | 10 |
| Тема 11. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска | 2 | 2 | 4 | 6 | 14 |
| Тема 12. Оценка риска и принятие решений в условиях неопределенности | 2 | 2 | 2 | 6 | 12 |
| Итого по разделу 2 | 16 | 8 | 18 | 38 | 80 |
| Всего по компоненту ОПОП | 28 | 14 | 28 | 74 | 144 |

6.3. Форма обучения – заочная, курс – 4, семестр – 8

| Наименования содержательных модулей и тем | Количество часов | | | | |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------|----------|-----------|-----------|
| | Лекц. | Лабор. | Практ. | СРС+К | Всего |
| Раздел 1 | | | | | |
| <i>Теоретические основы экономической безопасности субъектов экономики в рискованной среде</i> | | | | | |
| Тема 1. Понятия риска и неопределенности. Классификация рисков | 0,5 | 0 | 0,5 | 11 | 12 |
| Тема 2. Основные положения современной теории рисков | 0,5 | 0 | 0 | 7,5 | 8 |
| Тема 3. Типология решений и критерии выбора в рискованных ситуациях | 0,5 | 0,5 | 0,5 | 9,5 | 11 |
| Тема 4. Риск и неопределенность при информатизации бизнеса | 0,5 | 0,5 | 0,5 | 9,5 | 11 |
| Тема 5. Стандарты и методологии управления рисками | 0,5 | 1 | 0,5 | 8 | 10 |
| Тема 6. Риски в аутсорсинге | 0,5 | 1 | 0 | 10,5 | 12 |
| Итого по разделу 1 | 3 | 3 | 2 | 56 | 64 |

| Наименования содержательных модулей и тем | Количество часов | | | | |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|----------|----------|------------|------------|
| | Лекц. | Лабор. | Практ. | СРС+К | Всего |
| Раздел 2. Внешние предпринимательские риски и методы управления ими в системе функционирования предприятий | | | | | |
| Тема 7. Управление рыночными рисками | 0,5 | 0 | 0,5 | 15 | 16 |
| Тема 8. Управление кредитными рисками | 0,5 | 0 | 0 | 9,5 | 10 |
| Тема 9. Методы оценки рисков | 0,5 | 1 | 0,5 | 16 | 18 |
| Тема 10. Управление рисками | 0,5 | 0 | 0,5 | 9 | 10 |
| Тема 11. Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска | 0,5 | 0 | 0,5 | 13 | 14 |
| Тема 12. Оценка риска и принятие решений в условиях неопределенности | 0,5 | 0 | 0 | 11,5 | 12 |
| Итого по разделу 2 | 3 | 1 | 2 | 74 | 80 |
| Всего по компоненту ОПОП | 6 | 4 | 4 | 130 | 144 |

7. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ (СРЕДСТВА) ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

7.1. Контрольные вопросы

РАЗДЕЛ 1

ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ФУНКЦИОНИРОВАНИЯ ПРЕДПРИЯТИЙ В РИСКОВОЙ СРЕДЕ

1. Риск и неопределенность – взаимосвязь и различие понятий. Функции риска в экономике.
2. Классификация и характеристика рисков. Риски инвестиционного проекта.
3. Эволюция исследования неопределенности и риска. Аксиомы теории риска. Случайность как причина риска.
4. Концепция «риск-доходность». Модель CAPM.
5. Характеристика отношения индивидов к риску.
6. Индивиды, не склонные к риску или противники риска (risk-aversers); нейтральные к риску (risk-neutrals) и склонные к риску (risk-takers).
7. Модель выбора индивида в условиях неопределенности.
8. Функция полезности дохода индивида.
9. Безрисковый эквивалент и премия за риск.
10. Индексы неприятия риска Эрроу-Пратта.
11. Статистические методы исследования и оценки рисков: вероятность, мат. ожидание, дисперсия, среднеквадратическое отклонение, коэффициент вариации. Закон нормального распределения вероятностей. Правило «трех сигм».
12. Метод экспертных оценок.
13. Метод аналогий.
14. Ожидаемая полезность и теория риска Бернулли. Шкалы полезности. Функция полезности фон Неймана-Моргенштерна.
15. Управление рисками в системе менеджмента предприятия. Объект и субъект управления рисками. Основные задачи при управлении рисками. Принципы и правила управления рисками.
16. Этапы процесса управления риском: выявление (идентификация) риска, оценка риска, принятие решений, контроль риска. Информационное обеспечение процесса управления рисками.
17. Методы анализа риска: феноменологический, детерминистский, вероятностный, экспертный.

18. Методы оценки риска: статистический, вероятностно-статистический, теоретико-вероятностный, эвристический.
19. Методы прогноза риска. Показатели достоверности прогноза.
20. Организация управления рисками. Структура, уровни и механизмы управления рисками.
21. Процесс управления риском.
22. Принципы принятия решений об управлении рисками.
23. Классическая схема принятия решения.
24. Методы принятия рациональных решений.
25. Методы оптимизации решений по управлению рисками.
26. Теоретические основания и этапы эволюции риск-менеджмента.
27. Парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия.
28. «Колесо риск-менеджмента».
29. Понятие и виды стресс-тестирования. Требования регулирующих органов к проведению стресс-тестирования.
30. Информатизация бизнеса. Специфика ИТ-отрасли.
31. Классификация рисков в проектах. Формулировка риска (по MSF). Планирование и идентификация рисков.
32. Процесс выявления рисков (по MSF).
33. Классификация стандартов управления рисками.
34. Методология PMBoK (Project Management Body of Knowledge).

РАЗДЕЛ 2

ВНЕШНИЕ ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКИЕ РИСКИ И МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ ИМИ В СИСТЕМЕ ФУНКЦИОНИРОВАНИЯ ПРЕДПРИЯТИЙ

1. Методы управления рисками: диверсификация, страхование, хеджирование.
2. Имитационная модель оценки риска. Анализ чувствительности результатов проекта к изменению условий его реализации.
3. Метод корректировки на риск денежного потока инвестиционного проекта.
4. Метод корректировки на риск коэффициента дисконтирования инвестиционного проекта.
5. Критерии оценки риска при отсутствии данных о вероятности возможных исходов. Понятие субъективной вероятности.
6. Критерии принятия решений в условиях неопределенности: критерий крайнего пессимизма (Вальда, максимина), критерий крайнего оптимизма (максимакса), альфа-критерий Гурвица, критерий Сэвиджа (критерий отказа от минимакса), критерий Лапласа (Байесово решение).
7. Выбор критерия в зависимости от рискованных обстоятельств.
8. Портфельный подход к системе управления рисками.
9. Tактический и стратегический риск-менеджмент.
10. Модель оценки капитальных активов (CAPM).
12. Концепция стоимостной меры риска (VaR).
12. Современные проблемы риск-менеджмента.
13. Понятие кредитного риска. Классификация кредитных рисков.
14. Финансовые институты и инструменты, подверженные кредитному риску.
15. Показатели кредитного риска. Кредитное событие.
16. Классический анализ кредитоспособности заемщика.
17. Понятие кредитного рейтинга.
18. Модели оценки кредитоспособности

7.2. Темы докладов (рефератов)

Не предусмотрены программой дисциплины

7.3. Темы письменных работ (типы задач)

На примере выбранного студентом проекта (перспективного, находящегося в разработке или уже реализованного на практике) разработать кейс, включающий все аспекты управления рисками на предприятии.

Требования к содержанию кейса «Создание/совершенствование управления рисками на предприятии»

название предприятия

Кейс по управлению проектом структурно должен включать следующие **разделы**:

1. Оценка структуры управления рисками.
2. Используемые практики управления рисками.
3. Построение реестров риска для предприятия.
4. Создание \ совершенствование СУР.

Требования относительно оформления кейса.

Проект готовится и сдается в электронном и печатном виде и должен отвечать следующим требованиям:

- **по структуре:** Титульный лист; Содержание; Разделы и подразделы; Список использованных источников (не менее 10).

- **по оформлению:**

Шрифт Times New Roman, кегель 14, интервал 1,5.; Нумерация страниц сверху, справа. Поля: левое – 3 см, верхнее и нижнее – 2 см, правое – 1,5 см.; Обязательные ссылки на использованные источники информации, включая интернет-ресурсы.; Объем работы – 15-20 страниц.

Все расчеты должны выполняться в Excel. Кейс должен быть хорошо иллюстрирован графически. В конце работы ставится подпись автора и дата.

Модульная контрольная работа проводится в виде тестирования на платформе onlinetestpad. Тестирование включает 20 тестовых заданий по темам 1-5. Время выполнения – 30 минут. Пример тестового задания приведен ниже.

15 из 19

Утверждение о том, что «деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» отражает смысл...

☒ закона неизбежности риска

☐ закона сочетания потенциальных потерь и выгод

☐ закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

15

15 из 19

Диаграмма «галстук-бабочка»
Bow-Tie Analysis

Используя метод "галстук-бабочка" дать оценку риску ДПЗ:

Вынужденная приостановка производства из-за невозможности получения официальной лицензии на производство продукции

Выберите файл: Выберите файл Файл не выбран

Критерии оценивания задания модульного контроля

| Вид задания | Количество баллов |
|--------------------|-------------------|
| 1 тестовое задание | 0,25 |
| Количество тестов | 20 |
| Всего | 5 |

7.4. Образец содержания экзаменационного билета (при наличии экзамена по дисциплине)

Донецкий государственный университет
Экономический факультет
Кафедра экономики предприятия

| | |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------|
| Программа высшего образования | Программа специалитета |
| Специальность | 38.05.01 Экономическая безопасность |
| Специализация | Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности |
| Форма обучения | Очная, заочная |
| Семестр | Восьмой |
| Дисциплина | Управление рисками |

Билет № n

1. Теоретические задания

1. Концепция «риск-доходность». Модель CAPM.

2. Тестовые задания

2.1. Какая группа не влияет на возникновения неопределенности и вызванного ею риска?

- а) Многокритериальность и конфликтность в оценке решений;
- б) Зависимость от поставщиков;
- в) Асимметрия информации;
- г) Индертерминированность многих процессов и явлений, которые влияют на экономику.

2.2. В энциклопедическом словаре дается следующая трактовка: «Неопределенность – это

- а) Невозможность оценки будущего развития событий с точки зрения вероятности их реализации, так и с точки зрения вида их проявления;
- б) Возможность оценки будущего развития событий с точки зрения вероятности их реализации, так и с точки зрения вида их проявления;
- в) Достаточность информации об условиях, в которых будет осуществляться экономическая деятельность, низкая степень предсказуемости, прогнозирования этих условий;
- г) Достаточность и возможность оценки будущего развития событий с точки зрения вероятности реализации и прогнозирования условий при которых осуществляется деятельность.

2.3. Что понимается под хозяйственной неопределенностью?

- а) Определенное состояние отношений между субъектами хозяйствования в условиях одновариантного развития хозяйственной ситуации, когда подробная информация об этих условиях отсутствует;
- б) Определенное состояние отношений между субъектами хозяйствования в условиях многовариантного развития хозяйственной ситуации, когда подробная информация об этих условиях присутствует;

в) Определенное состояние отношений между субъектами хозяйствования в условиях многовариантного развития хозяйственной ситуации, когда подробная информация об этих условиях отсутствует;

г) Определенное состояние отношений между субъектами хозяйствования в условиях одновариантного развития хозяйственной ситуации, когда подробная информация об этих условиях присутствует.

2.4. Какие два типа неопределенности выделяют в исследованиях по экономическому прогнозированию и планированию?

- а) достоверная и истинная;
- б) достоверная и информационная;
- в) информационная и правовая;
- г) истинная и финансовая.

2.5. Сколькими главными причинами в развитии экономики неопределенность вызывается?

- а) две причины;
- б) три причины;
- в) четыре причины;
- г) шесть причин;

2.6. Каким способом осуществляется учет неопределенности?

- а) проверкой устойчивости разработанного проекта (программы);
- б) корректировкой параметров проекта (программы) и экономических нормативов;
- в) формализованным описанием неопределенности;
- г) коэффициент параметров проекта

2.7. Какой из методов анализа целесообразно применить для выявления стратегических рисков?

- а) HAZOP;
- б) FTA;
- в) PESTLE;
- г) FMEA.

2.8.. Что является преимуществом экспертных методов расчета рисков по сравнению со статистическими?

- а) возможность расчета финансовых рисков
- б) привлечение квалифицированных экспертов
- в) возможность расчета рисков опасностей
- г) возможность оценки любого риска.

2.9. Какой тип рисков невозможно рассчитать статистическими методами?

- а) стратегический;
- б) операционный;
- в) риск прочих опасностей;
- г) финансовый.

2.10. Главным инструментом статистического метода расчета риска является:

- а) коэффициент конкордации;
- б) коэффициент ликвидности;
- в) коэффициент вариации;
- г) коэффициент восстановления платежеспособности.

Критерии оценивания экзаменационного билета

| Вид задания | Количество баллов |
|-----------------------|-------------------|
| Теоретическое задание | 10 |
| Задача | 20 |
| 10 закрытых тестов | 10×1=10 |
| Всего | 40 |

8. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Для определения степени усвоения студентами материала по дисциплине «Управление рисками» предусмотрен текущий, модульный и итоговый контроль знаний. Для оценки качественного уровня знаний студентов используется комплекс методов контроля: устный опрос, тесты, решение задач, модульная контрольная работа, защита курсовой работы, зачет и экзамен. Заданием текущего контроля является проверка понимания и усвоения материала, выработанных умений самостоятельно прорабатывать учебные материалы, способности осмыслить содержание темы, умений публично или в письменном виде представить определенный материал.

| Содержательные модули | Виды работ | Баллы |
|-------------------------------|----------------------------------------------------|------------|
| Раздел 1 | Организационно-учебная работа студента в аудитории | 5 |
| | Модульная контрольная работа | 5 |
| | Итого | 10 |
| Раздел 2 | Организационно-учебная работа студента в аудитории | 2 |
| | Итого | 2 |
| Индивидуальная работа | | 32 |
| Самостоятельная работа | | 16 |
| Экзамен | | 40 |
| Всего | | 100 |

Порядок оценивания учебных достижений обучающихся

| Оценка по шкале ECTS | Оценка по 100-балльной шкале | Оценка по государственной шкале | |
|----------------------|------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| | | экзамен, дифференцированный зачет | зачет |
| A | 90-100 | 5 (отлично) | зачтено |
| B | 80-89 | 4 (хорошо) | зачтено |
| C | 75-79 | 4 (хорошо) | зачтено |
| D | 70-74 | 3 (удовлетворительно) | зачтено |
| E | 60-69 | 3 (удовлетворительно) | зачтено |
| FX | 35-59 | 2 (неудовлетворительно) с возможностью повторной аттестации | не зачтено |
| F | 0-34 | 2 (неудовлетворительно) с возможностью повторной сдачи при условии обязательного набора дополнительных баллов | не зачтено |

9. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА

Учебные занятия проводятся в 7-м и 5-м корпусах ДонГУ (г. Донецк, ул. Челюскинцев, 186; 1896). Для проведения лабораторных занятий требуется аудитория, оборудованная меловой или маркерной доской, мультимедийный проектор и экран, ноутбук, комплект учебной мебели для студентов, рабочее место преподавателя, выход в Интернет – проводной или с использованием Wi-Fi.

Для самостоятельной работы используются текстовые и электронные ресурсы Научной библиотеки университета и других электронных библиотечных баз данных, учебно-методическое обеспечение, представленное в учебно-методическом кабинете 7-го корпуса (ауд. 103).

Обучающиеся имеют возможность использовать учебные материалы по дисциплине, размещенные на платформе Moodle Центра дистанционного образования экономического факультета «ДонГУ». При изучении дисциплины применяются электронное обучение и дистанционные образовательные технологии.

С использованием ресурсов платформы дистанционного образования осуществляется текущий контроль знаний обучающихся на основе тестирования и проверки результатов самостоятельной работы.

Дистанционный курс «Управление рисками» для специальности 38.05.01 Экономическая безопасность» доступен по ссылке на платформе Moodle Центра дистанционного обучения экономического факультета ГОУ ВПО «ДОННУ»: <http://ef.donnusupport.ru/moodle/course/view.php?id=536>

10. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

10.1. Основная литература:

1. Управление рисками [Электронный ресурс] : библиографический список литературы / [сост. Н. А. Фесенко ; ред. В. А. Кротова] ; Донецкий нац. ун-т, Науч. б-ка, Отд. справ.-библиогр. и информ. работы. - Донецк : ДонНУ, 2016. - электронные данные (1 файл).
2. Управление рисками и антикризисная политика / А. Р. Эмексузьян, К. В. Балдин, А. Т. Алиев, О. С. Суртаева. – Сыктывкар : Коми республиканская академия государственной службы и управления, 2022. – 169 с. – ISBN 978-5-93206-408-5. – EDN ZEDYDT.

10.2. Дополнительная литература:

1. Балдин, К.В. Управленческие решения / К.В. Балдин, С.Н. Воробьев, В.Б. Уткин. – 8-е изд. – Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2017. – 495 с.
2. Уколов, А.И. Управление рисками страховой организации / А.И. Уколов. – 2-е изд., стер. – Москва : Директ-Медиа, 2017. – 468 с
3. Каранина, Е.В. Управление финансовыми рисками: стратегические модели и профессиональные стандарты / Е.В. Каранина. – Санкт-Петербург : ИЦ "Интермедия", 2017. – 168 с.
4. Кулешова, Е.В. Управление рисками проектов / Е.В. Кулешова ; Министерство образования и науки Российской Федерации, Томский Государственный Университет Систем Управления и Радиоэлектроники (ТУСУР). – 2-е изд., доп. – Томск : Эль Контент, 2015. – 188 с.
5. Фирсова, О.А. Управление рисками организаций / О.А. Фирсова ; Межрегиональная Академия безопасности и выживания. – Орел : МАБИВ, 2014. – 82 с.
6. Плотникова, М.С. Управление рисками / М.С. Плотникова. – Москва : Лаборатория книги, 2010. – 108 с

7. Пешкова, Г. Ю. Обеспечение кибербезопасности в эпоху пандемии: управление цифровыми рисками / Г. Ю. Пешкова, А. Ю. Самарина // Экономика Северо-Запада: проблемы и перспективы развития. – 2020. – № 4(63). – С. 187-191. – EDN YVVFLP.

8. Бектал, А. А. Управление рисками / А. А. Бектал // Вестник науки. – 2021. – Т. 4, № 3(36). – С. 34-38. – EDN IRLOCL.

11. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. **Национальная электронная библиотека (НЭБ):** федеральная государственная информационная система / Министерство Культуры РФ; Российская государственная библиотека. – Москва, 2019- . – URL: <https://rusneb.ru/> (дата обращения: 01.09.2023). – Режим доступа: свободный, подписка. Необходима установка программного обеспечения. – Текст: электронный.

2. **eLIBRARY.RU:** научная электронная библиотека: сайт. – Москва, 2000- . – URL: <https://elibrary.ru> (дата обращения: 01.09.2023). – Режим доступа: для авторизов. пользователей. – Текст: электронный.

3. Научная электронная библиотека **«КиберЛенинка»:** сайт / Ассоциация «Открытая наука». – Москва, 2014- . – URL: <https://cyberleninka.ru/>. – Режим доступа: свободный. – Текст: электронный.

4. Электронно-библиотечная система **«Лань»:** [сайт]. – URL: <https://e.lanbook.com> (дата обращения: 01.09.2023). – Режим доступа: для авторизов. пользователей. – Текст: электронный.

5. **ЭБС Юрайт:** электронная библиотечная система: сайт. – Москва, 2013. – URL: <https://biblio-online.ru> (дата обращения: 01.09.2023). – Режим доступа: для авторизов. пользователей. – Текст: электронный.

6. **Электронно-библиотечная система ДонГУ:** сайт / ФГБОУ ВО «ДонГУ». – Донецк, 2016- . – URL: <http://library.donnu.ru/> (дата обращения: 01.09.2023). – Режим доступа: свободный. – Текст: электронный.

7. **Электронный каталог** Научной библиотеки ДонГУ: раздел сайта / НБ ДонГУ. – Текст: электронный // ЭБС ДонГУ: сайт. – URL: <http://library.donnu.ru/catalog/> (дата обращения: 01.09.2023). – Режим доступа: поиск свободный, электронные документы – для пользователей ДонГУ.

8. **Электронный архив ДонГУ:** раздел сайта / НБ ДонГУ. – Текст: электронный // ЭБС ДонГУ: сайт. – URL: <http://repo.donnu.ru/> (дата обращения: 01.09.2023). – Режим доступа: свободный.

9. **Электронно - библиотечная система «Лань»** – URL: <https://e.lanbook.com> – URL: (дата обращения: 01.09.2023) – Режим доступа: свободный.

10. Журнал «Управление финансовыми рисками» WWW-адрес: <http://www.grebennikoff.ru/product/23/>

11. International Project Management Association. – Режим доступа: <https://www.ipma.world/>

12. Альт-Инвест. – Режим доступа: <https://www.alt-invest.ru/company/>

13. COSO ERM - концептуальные основы управления рисками организаций <https://www.pwc.ru/ru/services/audit/riskassurance/enterprise-risk-management/coso-erm.html>

12 ПРОГРАММНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

1. Windows 7 PRO (корпоративная лицензия ДонГУ № 46484614)
 2. Microsoft Office (корпоративная лицензия ДонГУ № 46472919)
 3. Microsoft Visual Studio (лицензия программы Dream Spark для высших учебных заведений)

4. Антивирус Касперского, Adobe Acrobat Reader, xPDF (лицензии GPL, Apache, BSD для свободного программного обеспечения).