



Государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
Московской области

**ТЕХНОЛОГИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ**

**«УТВЕРЖДАЮ»**

Проректор по  
учебно-методической работе  
*Н.В. Бабина*  
«28» 04 2020 г.

**ИНСТИТУТ ПРОЕКТНОГО МЕНЕДЖМЕНТА  
И ИНЖЕНЕРНОГО БИЗНЕСА**

**КАФЕДРА УПРАВЛЕНИЯ**

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА**

**ДИСЦИПЛИНЫ**

**«РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ В ПРОЕКТНОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ»**

**Направление подготовки:** 38.03.02 «Менеджмент»

**Профиль:** «Логистика»

**Квалификация (степень) выпускника:** бакалавр

**Форма обучения:** очная, заочная

Королев  
2020

**Автор: Гришина В.Т. Рабочая программа дисциплины: Риск- менеджмент в проектной деятельности. – Королев МО: «Технологический университет», 2020 г.**

**Рецензент: к.э.н., доцент Хорошавина Н.С.**

Рабочая программа составлена в соответствии с требованиями федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки бакалавров 38.03.02 «Менеджмент» и Учебного плана, утвержденного Ученым советом Университета. Протокол № 9 от 28.04. 2020 года.

**Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры:**

Заведующий кафедрой (ФИО, ученая степень, звание, подпись)	Веселовский М.Я. д.э.н., профессор <i>М.Я. Веселовский</i>	Веселовский М.Я. д.э.н., профессор <i>М.Я. Веселовский</i>	<i>М.Я. Веселовский</i>	<i>М.Я. Веселовский</i>
Год утверждения (переподтверждения)	2020	2021	2022	2023
Номер и дата протокола заседания кафедры	№ 10 от 20.04.2020	№ 13 от 11.06.2021	№ 13 от 07.06.2022	№ 9 от 22.04.2023

**Рабочая программа согласована:**

**Руководитель ОПОП**

*Л.Б. Лучицкая*

**к.э.н., доц. Л.Б. Лучицкая**

**Рабочая программа рекомендована на заседании УМС:**

Год утверждения (переподтверждения)	2020	2021	2022	2023
Номер и дата протокола заседания УМС	№ 7 от 28.04.2020	№ 4 от 15.06.2021	№ 5 от 21.06.2022	№ 6 от 16.05.2023

# 1. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОПОП

**Целью** изучения дисциплины является:

- формирование базовых компетенций для подготовки квалифицированных бакалавров в области управления рисками, с использованием полученных знаний и навыков в практической деятельности.

Дисциплина направлена на формирование следующих компетенций:

- владение навыками стратегического анализа, разработки и осуществления стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности (ПК-3);

- способность анализировать взаимосвязи между функциональными стратегиями компаний с целью подготовки сбалансированных управленческих решений (ПК-5);

- владеет навыками поэтапного контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов, умением координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ (ПК-7);

- владением навыками документального оформления решений в управлении операционной (производственной) деятельности организаций при внедрении технологических, продуктовых инноваций или организационных изменений (ПК-8);

- способность оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли (ПК-9);

- умением анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании (ПК-15).

**Основными задачами** дисциплины являются:

- формирование профессионального мышления студентов в контексте реализации функций управления рисками;

- освоение знаний и практических навыков в области анализа рыночных и специфических рисков;

- освоение методов снижения уровня рисков в процессе принятия управленческих решений.

После завершения изучения дисциплины студент должен:

**Знать:**

- основные законы и аксиомы процесса управления рисками;
- классификацию рисков деятельности;
- принципы системного управления рисками;
- основы анализа рисков для принятия управленческих решений;
- измерители рисков, методы идентификации рисков;
- методы оценки рисков;
- прикладные методы управления рисками.

**Уметь:**

- оперировать основным понятийным аппаратом в рамках изучаемой дисциплины;
- выявлять факторы рисков деятельности;
- документировать риски;
- использовать результаты анализа рисков для принятия решений;
- использовать методы количественного и качественного анализа рисков;
- самостоятельно работать с литературой по изучаемой дисциплине, критически осмысливать получаемую информацию, выражать и обосновывать свою позицию.

**Владеть:**

- основами методологии сбора информации по деятельности;
- основами оценки внешней и внутренней среды организации;
- навыками принятия управленческих решений, исходя из оценки последствий наступления рисков событий.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплина «Риск- менеджмент в проектной деятельности» относится к дисциплинам по выбору вариативной части основной образовательной программы подготовки бакалавров по направлению подготовки 38.03.02 «Менеджмент».

Дисциплина реализуется кафедрой управления.

Дисциплина базируется на ранее полученных знаниях по дисциплинам «Экономика предприятия и организация производства», «Основы бизнеса», «Методы разработки и принятия управленческих решений», «Информационные технологии в профессиональной деятельности», «Основы логистики» и формируемых в процессе их изучения компетенциях: ОК-3; ОПК-1; ОПК-2; ОПК-6; ОПК-7, ПК-5; ПК-9; ПК-10, ПК-11, ПК-12; ПК-13, ПК-15, ПК-17, ПК-19; ПК-20.

Знания и компетенции, полученные при освоении дисциплины, являются базовыми для прохождения преддипломной практики и выполнения выпускной квалификационной работы.

### 3. Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы, 108 час.

Виды занятий	Всего часов	Семестр 4	Семестр ...	Семестр 7	Семестр 8
<b>ОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ</b>					
<b>Общая трудоемкость</b>	<b>108</b>			<b>108</b>	
<b>Аудиторные занятия</b>	<b>32</b>			<b>32</b>	
Лекции (Л)	16			16	
Практические занятия (ПЗ)	16			16	
Лабораторные работы (ЛР)	-			-	
Контроль самостоятельной работы (КСР)	-			-	
<b>Самостоятельная работа</b>	<b>76</b>			<b>76</b>	
<b>Курсовые работы</b>	<b>-</b>			<b>-</b>	
<b>Контрольная работа, домашнее задание</b>	<b>Контр. работа</b>			+	
<b>Текущий контроль знаний (7 - 8, 15 - 16 недели)</b>	<b>-</b>			+	
<b>Вид итогового контроля</b>	<b>Зачет с оценкой</b>			+	
<b>ЗАОЧНАЯ ФОРМА ОБУЧЕНИЯ</b>					
<b>Виды занятий</b>	<b>Всего часов</b>				<b>Курс 4</b>
<b>Общая трудоемкость</b>	<b>108</b>				<b>108</b>
<b>Аудиторные занятия</b>	<b>12</b>				<b>12</b>
Лекции (Л)	4				4
Практические занятия (ПЗ)	8				8
Лабораторные работы (ЛР)	-				-
Контроль самостоятельной работы (КСР)	-				-
<b>Самостоятельная работа</b>	<b>96</b>				<b>96</b>
<b>Курсовые, расчетно-графические работы</b>	<b>-</b>				<b>-</b>
<b>Контрольная работа, Домашняя работа</b>	<b>Контр. работа</b>				+
<b>Текущий контроль знаний (7 – 8, 15 – 16 н</b>	<b>-</b>				-
<b>Вид итогового контроля</b>	<b>Зачет с оценкой</b>				+

## 4. Содержание дисциплины

### 4.1. Темы дисциплины и виды занятий

Таблица 2

Наименование тем	Лекции, час.	Практические занятия, час.	Занятия в интерактивной форме, час.	Код компетенций
Тема 1. Введение в дисциплину	2/-	2/-	-/-	ПК-9, ПК-15
Тема 2. Риск- менеджмент, как система организации и управления	2/1	2/2	-/-	ПК-9, ПК-15
Тема 3. Оценка и анализ рисков	2/1	4/2	-/-	ПК-7, ПК-8, ПК-9, ПК-15
Тема 4. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности	2/1	2/2	2/1	ПК-3, ПК-5, ПК-8, ПК-9, ПК-15
Тема 5. Инструментарий риск-менеджмента	4/1	4/2	2/1	ПК-3, ПК-5, ПК-7, ПК-9, ПК-15
Тема 6. Прикладные вопросы управления рисками	4/-	2/-	2/-	ПК-3, ПК-5, ПК-7, ПК-9, ПК-15
<b>Итого:</b>	<b>16/4</b>	<b>16/8</b>	<b>6/2</b>	

### 4.2 Содержание тем дисциплины

#### Тема 1. Введение в дисциплину

Риск как социально- экономическая категория, сущность риск-менеджмента. Понятие и сущность риска. Возможные причины возникновения рисков. Основные подходы к классификации рисков. Сущность, цель и задачи риск-менеджмента. Старая и новая парадигма риск-менеджмента.

#### Тема 2. Риск- менеджмент, как система организации и управления

Этапы процесса управления риском: планирование управления рисками, идентификация рисков, анализ риска и приоритизация рисков, планирование действий для снижения вероятности рисков, мониторинг рисков, контроль рисков.

Источники информации для идентификации рисков.

Визуализация рисков. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска. Рисковый капитал.

Основные этапы организации риск-менеджмента: мониторинг рисков; оценка рисков; определение толерантности организации к риску; определение расчетной эффективности принятого решения.

Варианты организации системы риск-менеджмента на предприятии: функционирование системы управления рисками без создания отдела по управлению рисками; созданию отдела (подразделения, службы) по управлению рискам организации.

Место отдела (подразделения, службы) по управлению рисками в организационной структуре предприятия.

### **Тема 3. Оценка и анализ рисков**

Качественные методы оценки рисков. Метод экспертных оценок. Способы определения достоверности экспертных оценок. Метод Дельфи. Анализ финансового состояния предприятия.

Количественные методы оценки рисков. Статистический метод. Аналитические методы: анализ сценариев, упрощенные коэффициентные методы определения риска.

Принятие оптимальных решений в условиях полной неопределенности, дерево решений.

Специфические методы оценки рисков: метод достоверных эквивалентов; метод корректировки нормы дисконта; метод оценки чувствительности.

Оценка эффективности методов управления риском.

### **Тема 4. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности**

Система неопределенностей. Критерии определения оптимальности в сфере неопределенности. Процедура подготовки, принятия и реализации управленческих решений. Зоны риска и ситуации неопределенности.

Методы разработки и принятия управленческих решений в системе риск-менеджмента.

### **Тема 5. Инструментарий риск-менеджмента**

Управление риском: возможности и последствия.

Классификация методов управления рисками: передача, уклонение, локализация, диссипация, компенсация. Возможности передачи риска: заключение контрактов; страхование как метод передачи рисков. Уклонение от риска: отказ от ненадежных партнеров, отказ от рискованных проектов, страхование хозяйственных рисков, поиск гарантов. Локализация: венчурные предприятия, создание специальных структурных подразделений (с обособленным балансом) для выполнения рискованных проектов, заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов. Диссипация риска: диверсификация и ее возможности. Компенсация риска: самострахование, хеджирование рисков.

Выбор инструментов снижения степени риска в конкретной ситуации. Универсальный алгоритм управления и минимизации рисков.

Инструментарий риск-менеджмента.

## **Тема 6. Прикладные вопросы управления рисками**

Управление риском: реальные возможности и последствия.

Классификация методов управления рисками: передача, уклонение, локализация, диссипация, компенсация. Возможности и способы передачи риска: заключение контрактов, страхование. Способы уклонения от риска. Локализация: венчурные предприятия, создание специальных структурных подразделений для выполнения рискованных проектов, заключение договоров о совместной деятельности.

Виды производственных рисков, их классификация. Оценка производственных рисков на основе матрицы «вероятность-ущерб». Определение класса риска по частоте и потенциальному ущербу. Метод индексов опасности. Страхование перерывов в производстве как метод управления производственными рисками.

Выбор методов снижения степени риска в конкретной ситуации.

### **5. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы по дисциплине**

1. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины «Риск-менеджмент в проектной деятельности» (Приложение 2 к рабочей программе).

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

Структура фонда оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине приведена в Приложении 1 к рабочей программе.

### **7. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины**

#### **Основная литература:**

1. Управление рисками организации: Учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 153 с.: 60x90 1/16 + ( Доп. мат. znanium.com). - (Высшее образование: Бакалавриат). (обложка) ISBN 978-5-16-010203-0, <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=475625>

2. Риск-менеджмент: Учебное пособие / Фомичев А.Н., - 4-е изд. - М.: Дашков и К, 2016. - 372 с. ISBN 978-5-394-02676-8

<http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=937403>

## Дополнительная литература:

1. Оценка рисков в проектном менеджменте : учебное пособие / Е.И. Капустина, О.П. Григорьева, Ю.С. Скрипниченко, С.А. Молчаненко, М.Г. Барсуков. - Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет, 2017. - 152 с. : ил. - Библиогр. В кн.

URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=484918>

2. Алексашкина, Е.И. Антикризисное управление на предприятии [Электронный ресурс]: учебное пособие / Е.И. Алексашкина, В.Л. Василёнок, В.В. Негреева. — Электрон. дан. — Санкт-Петербург : НИУ ИТМО, 2015. — 92 с. — Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/91503>.

## 8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «интернет», необходимых для освоения дисциплины

### Интернет-ресурсы:

1. <http://www.risk-online.ru/about> . Журнал «РИСК: Ресурсы, Информация, Снабжение, Конкуренция»
2. <http://www.riskovik.com/journal/>. Журнал «Рисковик»
3. [www.erisks.com](http://www.erisks.com) - сайт компании ERisk. Словарь, энциклопедия, статьи, касающиеся риск-менеджмента.
4. [www.riskmetrics.com](http://www.riskmetrics.com) - сайт компании RiskMetrics (JP Morgan). Описание методик.
5. [about.reuters.com/risk/risklibrary/](http://about.reuters.com/risk/risklibrary/) - материалы по управлению рисками Reuters.
6. [www.fast.ane.ru/menshikov/](http://www.fast.ane.ru/menshikov/) - статьи, касающиеся проблем рыночных рисков.
7. [www.bashedu.ru/konkurs/bakirov/aug/uprav.htm](http://www.bashedu.ru/konkurs/bakirov/aug/uprav.htm) - сборник статей по управлению рыночными рисками.
8. [www.riskman.ru](http://www.riskman.ru) - сайт Института Управления Рисками при Государственном Университете Управления.
9. [koshechkin.narod.ru/risk.html](http://koshechkin.narod.ru/risk.html) - количественный анализ рисков в инвестиционном проектировании.
10. [www.geocities.com](http://www.geocities.com) - информация по валютным рискам.
11. [http://studopedia.net/9\\_84529\\_lektsiya--prinyatie-resheniy-v-usloviyah-neopredelennosti.html](http://studopedia.net/9_84529_lektsiya--prinyatie-resheniy-v-usloviyah-neopredelennosti.html) - Технология принятия управленческих решений в условиях неопределённости.
12. <http://consulting.1c.ru/journal-article.jsp?id=401> «Управляем предприятием» (электронный журнал).
13. <http://grebennikon.ru/journal-23.html> -«Управление финансовыми рисками» (электронный журнал)

## 9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины приведены в Приложении 2.

#### **10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине**

**Перечень программного обеспечения:** Microsoft Office Power Point, Microsoft Office Word, Microsoft Office Excel.

**Электронные ресурсы образовательной среды «МГОТУ»:**

Рабочая программа и методическое обеспечение по дисциплине «Риск-менеджмент в проектной деятельности».

Информационные справочные системы: Консультант плюс

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

**Лекционные занятия:**

- аудитория, оснащенная презентационной техникой (проектор, экран);
- комплект электронных презентаций.

**Практические занятия:**

- аудитория, оснащенная мультимедийными средствами (проектор, ноутбук), демонстрационными материалами (наглядными пособиями);
- рабочее место преподавателя, оснащенное ПК с доступом в глобальную сеть Интернет.

**ИНСТИТУТ ПРОЕКТНОГО МЕНЕДЖМЕНТА  
И ИНЖЕНЕРНОГО БИЗНЕСА**

**КАФЕДРА УПРАВЛЕНИЯ**

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ  
ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ  
ПО ДИСЦИПЛИНЕ  
«РИСК- МЕНЕДЖМЕНТ В ПРОЕКТНОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ»**

**(Приложение 1 к рабочей программе)**

**Направление подготовки: 38.03.02 «Менеджмент»**

**Профиль: «Логистика»**

**Квалификация (степень) выпускника: бакалавр**

**Форма обучения: очная, заочная**

**Королев  
2020**

## 1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Индекс компетенции	Содержание компетенции (или ее части)	Раздел дисциплины, обеспечивающий формирование компетенции (или ее части)	В результате изучения раздела дисциплины, обеспечивающего формирование компетенции (или ее части), обучающийся должен:		
			знать	уметь	владеть
<b>ПК-3</b>	владение навыками стратегического анализа, разработки и осуществления стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности	Темы 4-6	Понятия системы управления рисками;	разрабатывать стратегию организации	навыками стратегического анализа, разработки и осуществления стратегии организации, направленной на обеспечение конкурентоспособности
<b>ПК-5</b>	способность анализировать взаимосвязи между функциональными стратегиями компаний с целью подготовки сбалансированных управленческих решений	Темы 4-6	Понятия системы управления рисками; методы оценки рисков	анализировать взаимосвязи между функциональным и стратегиями компаний с целью подготовки сбалансированных управленческих решений	основами методологии сбора информации
<b>ПК-7</b>	владеет навыками поэтапного контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов, умением координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ	Тема 3 Тема 5 Тема 6	- основные понятия контроля реализации управленческих решений; - методический инструментарий реализации управленческих решений	- применять методический инструментарий реализации управленческих решений	- навыками поэтапного контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов
<b>ПК-8</b>	владением навыками документального оформления решений в управлении	Темы 3 и 4	экономические основы поведения организаций,	оценивать воздействие макроэкономической среды на	навыками документального оформления решений в

	операционной (производственной) деятельности организаций при внедрении технологических, продуктовых инноваций или организационных изменений		структур рынков и конкурентной среды отрасли	функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски,	управлении операционной (производственной) деятельности организаций при внедрении технологических, продуктовых инноваций или организационных изменений
<b>ПК-9</b>	способность оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли	Темы 1-6	Понятия системы управления рисками; экономические основы поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли	- основные законы и аксиомы процесса управления рисками; - классификацию рисков, принципы системного управления рисками; оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ	самостоятельно работать с литературой по изучаемой дисциплине; основами методологии сбора информации

ПК-15	умением анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	Темы 1-6	методы идентификации рисков; основы анализа рисков для принятия управленческих решений методы оценки рисков; прикладные методы управления рисками	- документировать риски ; - выявлять факторы рисков деятельности принимать решения в целях снижения вероятности рисков использовать методы количественного и качественного анализа рисков использовать результаты анализа рисков для принятия решений	основами методологии сбора информации; основами оценки внешней и внутренней среды организации основами оценки внешней и внутренней среды организации навыками принятия управленческих решений, исходя из оценки последствий наступления рисков событий
-------	--	----------	---	--	--

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

Код компетенции	Инструменты, оценивающие сформированность компетенции	Показатель оценивания компетенции	Критерии оценки
ПК-3, ПК-5, ПК-7, ПК-8, ПК-9, ПК-15	Доклад в форме презентации	А) компетенция сформирована полностью- 5 баллов В) сформирована частично- 3-4 балла С) компетенция не сформирована- 2 и менее баллов	Проводится устно с использованием мультимедийных систем, а также с использованием технических средств Время, отведенное на процедуру – 7 - 10 мин. Неявка – 0. Критерии оценки: 1. Качество представленной презентации (0-2 балла). 2. Владение информацией и способность отвечать на вопросы аудитории (0-2 балла). 3. Самостоятельность подхода и качество раскрытия выбранной тематики (0-2 балла). Максимальная сумма баллов - 6 баллов. Результаты оценочной процедуры представляются обучающимся в срок не позднее 1 недели после проведения процедуры – для текущего контроля. Оценка проставляется в электронный журнал.
ПК-9 ПК-15	Письменное домашнее аналитическое задание	А) сформирована полностью- 5 баллов В) сформирована частично- 3-4 балла С) компетенция не сформирована- 2 и менее баллов	Проводится в письменной форме. Неисполнение – 0. Критерии оценки: 1. Выполнение требований по оформлению и форматированию домашней работы (0 - 2 балла). 2. Самостоятельность изложения и качество содержания (0-6 баллов); 2. Самостоятельность и глубина сделанных выводов (0-2 балла); Максимальная сумма баллов - 10 баллов. Результаты оценочной процедуры представляются обучающимся в срок не позднее 1 недели после проведения процедуры – для текущего контроля. Оценка проставляется в электронный журнал.
ПК-9 ПК-15	Письменное аудиторное задание	А) сформирована полностью- 5 баллов В) сформирована частично- 3-4 балла С) компетенция не сформирована- 2 и менее баллов	1. Проводится в форме письменной работы. 2. Время, отведенное на процедуру: 10 - 30 мин. Неявка – 0. Критерии оценки: 1. Соответствие содержания ответа заявленной тематике (0-4 балла); 2. Самостоятельность выводов (0-2 балла). Максимальная сумма баллов - 6 баллов. Результаты оценочной процедуры представляются обучающимся в срок не позднее 1 недели после проведения процедуры – для текущего контроля. Оценка проставляется в электронный журнал.

### **3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы**

#### **3.1 Примерная тематика докладов в презентационной форме:**

1. Элементы системы риск - менеджмента
2. Основные задачи риск- менеджмента
  2. Особенности управления рисками по типам рисков
  3. Российское и международное законодательство в сфере риск - менеджмента
  4. Внешние и внутренние источники рисков
  5. Взаимосвязь научных категорий «неопределенность» и «риски»
  6. Варианты организации риск- менеджмента на предприятии
  7. Риск – менеджмент в условиях инновационной деятельности
  8. Особенности организация риск - менеджмента в условиях разработки концепции нового товара
  9. Основные этапы организации риск - менеджмента
  10. Риск- менеджмент в структуре управления фирмой
  11. Сущность метод экспертных оценок
  12. Количественные методы оценки рисков
  13. Использование таблицы нормального распределения вероятностей для моделирования вероятностей
  14. Измерение риска на основе вероятностной оценки ожидаемых доходов
  15. Оценка несистематического риска
  16. Применение метода дерева решений для оценки значения денежных потоков по нескольким вариантам развития
  17. Оценка эффективности методов анализа в риск менеджменте
  18. Реализация управленческого решения в условии неопределенности на примере деятельности риск - менеджера фирмы
  19. Определение зоны риска в ситуации неопределенности на примере деятельности фирмы
  20. Информационное обеспечение риск- менеджмента
  21. Методы идентификация и анализа риска
  22. Диверсификация как метод управления риском
  23. Методы финансирования рисков
  24. Современные методы уклонения от риска
  25. Определение класса риска по частоте
  26. Определение класса риска по потенциальному ущербу
  27. Современные методы управления производственными рисками
  28. Использование методики Value-at-Risk для оценки возможных потерь рыночной стоимости портфеля ценных бумаг
  29. Особенности управления отдельными сегментами кредитного портфеля

#### **3.2 Примерная тематика письменного практического задания**

1. Классификация рисков.
2. Разработка анкеты идентификации рисков подбора команды проекта.

3. Оценка и анализ рисков на примере инженерно-эксплуатационной службы реального предприятия.
4. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности.
5. Риск-анализ инвестиционного проекта методом сценариев.
6. Анализ границ безубыточности фирмы
7. Оценка безубыточности деятельности

### **3.3 Примеры письменного задания:**

#### **Задание 1. Обоснование сущности проекта (аудиторная работа)**

Руководством университета в январе было принято решение о выпуске фильма о его образовательной деятельности..

Этот фильм призван улучшить имидж учебного заведения. Под имиджем следует понимать:

формирование и поддержание устойчивого положительного впечатления, каким его видят общественность, студенты и других уч. заведений ВПО, учащиеся школ и родители учеников, руководство города, сотрудники университета, учредители.

Видеофильм должен быть направлен не только на внешнюю среду, но и на коллектив своих сотрудников и студентов с целью формирования благоприятных внутри коллективных отношений, неформальной атмосферы, способствующих позитивной работе и мотивации труда и учебного процесса.

Каждый студент группы выступает профессиональным менеджером проекта и каждый приглашен возглавить этот проект. Кроме того, каждый — автор идеи создания видеофильма.

На реализацию этого проекта предоставлено 3 месяца.

Пожелание руководства университета— реализовать проект в самые короткие сроки.

Необходимо:

1. Дать обоснование инициации проекта.
2. Указать основную цель и продукт проекта,
3. Основные характеристики продукта.
4. Желаемые результаты проекта.
5. Критерии успеха проекта.
6. Возможные риски проекта

*Сделать обобщающие выводы.*

#### **Задание 2. Классификация рисков**

Цель задания: *каждый из перечисленных рисков отнести к одной из групп, согласно их классификации.*

Условие задания:

Дан следующий перечень рисков.

- 1) Риск аварии грузового судна во время перевозки груза, ожидаемого компанией.
- 2) Риск слишком резкого снижения курса USD для компании, осуществляющей экспортные операции.

- 3) Риск возникновения сбоя в поставках сырья.
- 4) Риск снижения спроса на продукцию предприятия.
- 5) Риск отвержения рынком нового товара организации.
- 6) Риск потери прибыли в результате снижения рыночных цен на товар.
- 7) Риск просрочки выплаты долга дебитором.
- 8) Риск разрушения складского помещения фирмы в результате стихийного бедствия.
- 9) Риск поражения вирусом компьютерных сетей компании.
- 10) Риск утечки информации, представляющей коммерческую тайну.
- 11) Риск возникновения на рынке нового сильного конкурента.
- 12) Риск потери платежеспособности.
- 13) Риск превышения спросом производственных мощностей предприятия.
- 14) Риск поставки низкокачественных материалов поставщиком (с большой долей брака).
- 15) Риск резкого скачка текучести кадров.
- 16) Риск остановки производства в результате выхода из строя оборудования.
- 17) Риск ухода с рынка основного промышленного потребителя продукции предприятия.
- 18) Риск банкротства банка, обслуживающего организацию.
- 19) Риск отказа инвестора от дальнейшего финансирования проекта в процессе его реализации.
- 20) Риск ухода ведущих специалистов компании.

*Инструкция:* группа студентов разбивается на временные творческие коллективы (ВТК), каждый коллектив готовит свои предложения, согласно заданию.

*Групповое обсуждение:* участники ВТК обосновывают выводы на основе классификационных признаков.

### **Задание 3. Разработка анкеты идентификации рисков подбора команды проекта.**

Цель анкетирования - ответ на вопрос, достаточно ли внимание при разработке проекта уделено каждому виду риска.

В качестве проекта можно рассматривать проект разработки системы управления инженерно - эксплуатационной службой предприятия (ИЭС) в реальных организационно – технических условиях.

Примерный перечень вопросов для проектирования анкеты:

1. Реализован ли при формировании команды проекта наилучший выбор из возможных?
2. Существует ли возможность внутренних конфликтов в команде проекта? Какова их возможная причина?
3. Отвечает ли количественный состав членов проектного коллектива целевым задачам проекта?
4. Отвечает ли профессиональный состав членов проектного коллектива целевым задачам проекта?
5. Каковы функции членов проектного коллектива?
6. Оценить возможную текучесть персонала, занятого в проекте.

Разработать анкету идентификации рисков подбора команды проекта на стадии планирования проекта.

Разработать анкету идентификации рисков подбора команды проекта на стадии внедрения проекта.

### **3.4 Примерные тестовые вопросы для контроля знаний**

#### **1. Риск – это:**

- 1) неблагоприятное событие, влекущее за собой убыток;
- 2) все предпосылки, могущие негативно повлиять на достижение стратегических целей в течение строго определенного временного промежутка;
- 3) вероятность наступления стихийных бедствий либо технических аварий;
- 4) вероятность провала программы продаж;
- 5) вероятность успеха в бизнесе.

#### **2. Управление риском – это:**

- 1) отказ от рискованного проекта;
- 2) комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска;
- 3) комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие
- 4) риска или уход от него;
- 5) комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска.

#### **3. Управление рисками на современных предприятиях включает в себя:**

- 1) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска;
- 2) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска;
- 3) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности;
- 4) умение ликвидировать такие последствия;
- 5) разработка и осуществление мер, при помощи которых могут быть нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные результаты предпринимаемых действий.

#### **4. Содержательная сторона управления рисками проекта включает в себя:**

- 1) планирование деятельности по реализации рискованного проекта;
- 2) сравнение вероятностей и характеристик риска, полученных в результате оценки и анализа риска;
- 3) выбор мер по минимизации или устранению последствий риска;
- 4) организация службы управления рисками на предприятии.

#### **5. Что из перечисленного не является элементом системы управления рисками?**

- 1) выявление расхождений в альтернативах риска;
- 2) разработка планов, позволяющих действовать оптимальным образом в ситуации риска;
- 3) разработка конкретных мероприятий, направленных на минимизацию или устранение негативных последствий;
- 4) учет психологического восприятия рискованных проектов;
- 5) ни один из вариантов не является элементом системы управления рисками;
- 6) все перечисленное является элементами системы управления рисками.

#### **6. Системный риск – это:**

- 1) риск ухудшения конъюнктуры какого-либо рынка;
- 2) риск разрушения системы управления организацией;
- 3) общая система рисков, которым подвергнута организация;
- 4) система оценки и управления рисками.

#### **7. Инновационный риск – это:**

- 1) риск срыва сроков сдачи результатов научно-технических исследований;
- 2) риск того, что новый товар не будет принят рынком;
- 3) риск того, что инновационный проект не будет реализован или окуплен;
- 4) риск, связанный с утечкой информации об используемых фирмой инновациях.

**8. Что их перечисленного не относится к видам производственных рисков?**

- 1) изменение конъюнктуры рынка;
- 2) усиление конкуренции;
- 3) форс-мажор;
- 4) амортизация производственного оборудования.

**9. По времени возникновения неопределенности распределяются на:**

- 1) ретроспективные, текущие и перспективные;
- 2) экономические (коммерческие) и политические;
- 3) новые и старые;
- 4) изученные, изучаемые и неизученные.

**10. Прием, нацеленный преимущественно на возмещение материального ущерба от проявления рисков:**

- 1) лимитирование;
- 2) локализация;
- 3) страхование;
- 4) хеджирование.

**11. Первая точка кривой рисков определяет:**

- 1) величину потерь, равных расчетной выручке;
- 2) вероятность нулевых потерь;
- 3) вероятности нежелательного исхода.

**12. Разновидностью экспертного метода является:**

- 1) метод Дельфи;
- 2) метод Гаусса;
- 3) метод Гейссона.

**13. Методы управления рисками, предполагающие исключение рискованных ситуаций из бизнеса, носят название:**

- 1) методы диссипации риска;
- 2) методы компенсации риска;
- 3) методы уклонения от риска;
- 4) методы локализации риска.

**14. Методы управления рисками, основанные на четкой идентификации источников риска, носят название:**

- 1) методы диссипации риска;
- 2) методы компенсации риска;
- 3) методы уклонения от риска;
- 4) методы локализации риска.

**15. К покрытию убытка на основе страхования прибегают в следующих случаях:**

- 1) инвестирование средств страховых фондов в пределах одной деловой единицы;
- 2) сохранение прибыли внутри соответствующей группы;
- 3) получение льгот по налогообложению (которые могут быть предусмотрены в некоторых странах);
- 4) если существуют большие совокупности рисков, вероятность реализации которых велика, а суммы предполагаемого ущерба небольшие.

**16. При получении банковского кредита под инвестиционную программу могут возникнуть неопределенности:**

- 1) неопределенность в ожидаемых сроках поступлений денежных средств на счет фирмы;
- 2) неопределенность периода погашения ссуды;
- 3) неопределенность абсолютного количества денежных средств, уплачиваемых за использование банковского кредита;
- 4) все ответы верны.

**17. Логистика – это:**

- 1) способ ведения бухгалтерского учёта;
- 2) теория и практика управления материальными потоками;
- 3) наука, изучающая логическое мышление людей;
- 4) наука о словах.

**18. Зав. кафедрой Управления просит вас подготовить новый материал и изменить страницу кафедры в Интернете. Это можно назвать:**

- 1) Инициация проекта.
- 2) Повторяющаяся операция.
- 3) Проект.
- 4) Выполнение проекта.

**19. Ваша компания занимается производством мелких кухонных приборов. Она вводит новую линию приборов, в которой будут использованы новые цвета. Эта продукция должна быть представлена в весеннем каталоге. Какое из следующих утверждений верно:**

- 1) Это проект, так как подобный продукт никогда ранее не производился и не продавался компанией.
- 2) Это повторяющаяся операция, так как компания производит кухонные приборы. Использование новых цветов и характеристик является простым дополнением к существующему процессу.
- 3) Это повторяющаяся операция, так как новая линия продукта станет постоянной. Это не временное явление.
- 4) Это не проект и не повторяющаяся операция. Это разработка нового продукта.

**20. Показатель, в наибольшей степени характеризующий эффективность системы технического контроля, - это:**

- 1) количество работников контрольной службы;
- 2) количество случаев выявления брака;
- 3) количество полученных рекламаций;
- 4) количество дел, выигранных в арбитражном суде по искам потребителей в связи с несоблюдением требований по качеству поставленной продукции.

**21. Вы — руководитель большого строительного проекта. Цель проекта состоит в том, чтобы построить несколько зданий для людей, обслуживающих Олимпийские игры, которые состоятся в вашем город через 18 месяцев с даты начала проекта. Бюджет этого проекта составляет 12 млн долларов. Ресурсы определены. Что является основными условиями для этого проекта:**

- 1) Время, так как дата не может быть перенесена.
- 2) Деньги, так как бюджет составляет 12 млн долларов.
- 3) Ресурсы, так как они не фиксированы.
- 4) Качество, так как постройки должны быть функциональными и безопасными.

**22. Экспертные методы оценки рисков проекта включают следующие этапы:**

- 1) определения цели и задач экспертной оценки
- 2) создание рабочей группы экспертов
- 3) выбор методов получения исходной информации
- 4) предварительная экспертиза
- 5) опрос экспертов
- 6) обработка результатов
- 7) интерпретация экспертами результатов
- 8) составление отчета

**23. Ограничения, которые должны соблюдаться при расчете точки безубыточности:**

- 1) объем производства равен объему продаж
- 2) постоянные затраты одинаковы для любого объема производства
- 3) переменные издержки изменяются пропорционально объему производства
- 4) цена единицы ресурсов должна быть постоянной
- 5) цены единицы продукта должны соответствовать изменениям внутриотраслевых цен

**24. Во время какого процесса управления проектом существует риск и способность участников проекта оказывать наиболее сильное влияние на его результат?**

- 1) Планирование.
- 2) Выполнение.
- 3) Инициация.
- 4) Контроль.

**25. К макрологистической системе относят...**

- 1) Крупная железнодорожная станция.
- 2) Связанные договорами поставщик, покупатель и транспортная организация.
- 3) Взаимосвязанные участники цепи, обеспечивающие продвижение материального потока в пределах металлургического комбината.

**26. В зависимости от источника возникновения риски делятся на:**

- 1) организационные риски, возникающие из-за недоработок на уровне топ-менеджера проекта
- 2) не систематические финансовые риски, связанные с изменчивостью рыночной конъюнктуры
- 3) не систематические экономические риски, связанные с непредсказуемостью регулирования в сфере ценообразования
- 4) систематические риски в процессе подбора персонала проекта
- 5) технические риски в связи с изменениями бизнес-среды и бизнес-условий, в которых осуществляется проект

**27. Неопределенность в процессе разработки проекта, это:**

- 1) возможность выбора из нескольких вариантов решений проекта
- 2) некорректная информация о ресурсах проекта
- 3) конфликт интересов при обсуждении проекта
- 4) альтернативность выбора в процессе разработки проекта

**28. К теоретическим методам исследования системы управления рисками проекта относят:**

- 1) метод формализации
- 2) метод аксиоматизации
- 3) метод эксперимента
- 4) метод идеализации
- 5) метод моделирования

**29. План управления рисками обычно включает в себя:**

- 1) определение инструментов управления рисками проекта
- 2) распределение ролей и ответственности
- 3) оценка стоимости мероприятий, необходимых для управления рисками
- 4) оценку эффективности мероприятий управления рисками
- 5) категории рисков

**30. Типы задач количественного анализа рисков:**

- 1) прямые
- 2) обратные
- 3) исследования устойчивости результивных, критериальных показателей по отношению к вариациям исходных параметров
- 4) множественные
- 5) логарифмические
- 6) аналитические

**30. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций**

Формой контроля знаний по дисциплине «Риск- менеджмент в проектной деятельности» являются две текущие аттестации в виде электронного тестирования на зачетных неделях и одна промежуточная аттестация в виде зачета с оценкой в устной форме.

Оценка за освоение дисциплины определяется как комплексная оценка. Для её определения используется балльно-рейтинговый подход, учитывающий работу студента на лекциях, практических занятиях, оценку за контрольную работу, оценку за тесты.

Неделя текущего контроля	Вид оценочного средства	Код компетенции, оценивающий знания, умения, навыки	Содержание оценочного средства	Требования к выполнению	Срок сдачи (неделя семестра)	Критерии оценки по содержанию и качеству с указанием баллов
--------------------------	-------------------------	---	--------------------------------	-------------------------	------------------------------	---

Согласно учебно-графика	Тестирование	ПК-3, ПК-5, ПК-7, ПК-8, ПК-9 ПК-15	20 вопросов	Компьютерное тестирование; время, отведенное на процедуру -30 минут	Результаты тестирования предоставляются в день проведения процедуры	Критерии оценки определяются процентным соотношением. Не явка -0 Удовлетворительно - от 51% правильных ответов. Хорошо - от 70%. Отлично – от 90%.
Согласно учебно-графика	Тестирование	ПК-3, ПК-5, ПК-7, ПК-8, ПК-9 ПК-15	20 вопросов	Компьютерное тестирование; время отведенное на процедуру – 30 минут	Результаты тестирования предоставляются в день проведения процедуры	Критерии оценки определяются процентным соотношением. Не явка -0 Удовлетворительно - от 51% правильных ответов. Хорошо - от 70%. Отлично – от 90%. Максимальная оценка – 5 баллов.
Согласно учебно-графика	Зачет с оценкой	ПК-3, ПК-5, ПК-7, ПК-8, ПК-9 ПК-15	2 вопроса	Зачет с оценкой проводится в устной форме, путем ответа на вопросы. Время отведенное на процедуру – 20 минут.	Результаты предоставляются в день проведения зачета с оценкой	Критерии оценки: <b>Оценка «отлично»:</b> 1. знание основных понятий дисциплины; 2. умение использовать и применять полученные знания на практике; 3. работа на семинарских и практических занятиях; 4. знание основных научных теорий дисциплины; 5. ответ на вопросы <b>Оценка «хорошо»:</b> 1. знание основных понятий предмета; 2. знание основных научных теорий дисциплины; 3. работа на семинарских и практических занятиях; 4. допускает ошибки при применении полученных знаний на практике; 5. ответ на вопросы <b>Оценка «удовлетворительно»:</b> 1. знание основных понятий предмета; 2. допускает ошибки в знаниях основных научных теорий дисциплины; 3. работа на семинарских и практических занятиях; 4. допускает ошибки при применении полученных знаний на практике; 5. ответ на вопросы содержит

				<p>одну ошибку в каждом вопросе</p> <p><b>Оценка «не удовлетворительно»:</b></p> <p>-демонстрирует частичные знания по темам дисциплины;</p> <p>-незнание основных понятий предмета;</p> <p>-неумение использовать и применять полученные знания на практике;</p> <p>-не работал на семинарских и практических занятиях;</p> <p>-не отвечает на вопросы</p>
--	--	--	--	---

#### 4.1. Типовые темы контрольных работ

##### Теоретический вопрос № 1:

1. Цель, принципы, методы управления риском
2. Характеристика систем управления деятельностью
3. Сущность планирования управления рисками
4. Стратегии и инструменты реагирования на риски
5. Стандарты в области управления рисками
6. Риски и пути их снижения в организационной системе управления
7. Проект и программа управления рисками: основные характеристики.
8. Применение «дерева решений» при анализе рисков
9. Основные понятия риска в системе управления
10. Планирование реагирования на риски
11. Основные свойства систем управления, как условие снижения рисков.
12. Определение вероятности риска.
13. Мониторинг управления риском.
14. Методы трансформации рисков: разделение риска.
15. Методы трансформации рисков: предотвращение убытка.
16. Методы трансформации рисков: отказ от рисков.
17. Методы обнаружения и идентификации рисков: опрос экспертов.
18. Методы обнаружения и идентификации рисков: метод номинальных групп.
19. Методы обнаружения и идентификации рисков: метод Дельфи.
20. Методы обнаружения и идентификации рисков: метод аналогии.
21. Методы обнаружения и идентификации рисков: контрольные списки.
22. Методы обнаружения и идентификации рисков: карточки Кроуфорда.
23. Методы обнаружения и идентификации рисков: анализ документации
24. Методы обнаружения и идентификации рисков: анализ внешней среды.
25. Методы обнаружения и идентификации рисков: анализ внутренней среды.
26. Методы исследования систем управления
27. Управление рисками на этапах жизненного цикла продукта
28. Количественный анализ рисков.

29. Качественный анализ рисков: этапы анализа. Толерантность к риску.

**Практический вопрос №2 (на примере конкретной ситуации)**

1. Анализ рисков бюджета семьи на предстоящий год.
2. Принципы, методы управления риском и возможности их снижения (на примере...)
3. Система управления деятельностью (в .....)
4. Планирование управления рисками (в .....)
5. Стратегии и инструменты реагирования на риски (на примере...)
6. Реализация стандартов в области управления рисками (в .....)
7. Риски и пути их снижения в организационной системе управления (на примере...)
8. Проект и программа управления рисками: основные характеристики (на примере...)
9. Применение «дерева решений» при анализе рисков (в .....)
10. Основные понятия риска в системе управления (на примере...)
11. Планирование реагирования на риски (на примере...)
12. Особенности организации управления , как условие снижения рисков (на примере...)
13. Определение вероятности риска (на примере...)
14. Мониторинг управления риском (в ...)
15. Методы трансформации рисков проекта: разделение риска (на примере...)
16. Методы трансформации рисков : предотвращение убытка (на примере...)
17. Методы трансформации рисков (на примере...)
18. Методы обнаружения и идентификации рисков (на примере...)
19. Методы обнаружения и идентификации рисков: метод номинальных групп (на примере...)
20. Методы обнаружения и идентификации рисков: метод Дельфи (на примере...)
21. Методы обнаружения и идентификации рисков: метод аналогии (на примере...)
22. Методы обнаружения и идентификации рисков: контрольные списки (на примере...)
23. Методы обнаружения и идентификации рисков: применение карточки Кроуфорда (на примере...)
24. Методы обнаружения и идентификации рисков: анализ документации (на примере...)
25. Методы обнаружения и идентификации рисков: анализ среды (на примере...)
26. Методы исследования систем управления (на примере...)
27. Управление рисками на этапах жизненного цикла продукта (на примере...)
28. Количественный анализ рисков (на примере...)

29. Качественный анализ рисков (на примере...)

**4.2. Типовые вопросы, выносимые на зачет с оценкой**

1. Алгоритм управления риском
2. Дерево решений, как метод анализа риска
3. Жизненный цикл проекта в системе управления рисками
4. Идентификация рисков
5. Иерархическая структура рисков
6. Классификация рисков и их последствий
7. Критерии принятия рискованных решений в деятельности
8. Международные стандарты в области управления рисками
9. Метод Delphi и метод номинальной группы в методологии оценки рисков
10. Методы обнаружения рисков: контрольные списки, матричный анализ, метод аналогии, анализ среды.
11. Методы расчета границ безубыточности, как оценки риска
12. Мозговой штурм, как метод идентификации рисков
13. Национальные стандарты в области управления рисками
14. Общая классификация рисков
15. Общий алгоритм исследования рисков
16. Основные законы и аксиомы процесса управления рисками
17. Основные понятия управления рисками проекта: риск, категория рисков, процесс управления рисками
18. Основные принципы и методы планирования управления рисками.
19. Основные принципы управления рисками
20. Основные свойства концептуальных систем управления рисками
21. Основные характеристики риска и неопределенности событий в проектной деятельности
22. Оценка рисков инвестиционного проекта
23. Планирование управления рисками
24. Понятие эффективности управления риском
25. Проектная документация в системе управления рисками
26. Риски внешней среды
27. Риски организационной системы управления
28. Способ обнаружения и идентификации рисков: анализ документации, карточки Кроуфорда, опрос экспертов
29. Стратегии и инструменты реагирования на риски
30. Структура управления рисками
31. Сущность планирования управления рисками
32. Типовая оценка факторов риска
33. Типы задач количественного анализа рисков
34. Типы факторов рисков

**35.** Условия минимизации степени неопределенности событий в управлении рисками

**36.** Финансовые, маркетинговые и организационные источники стоимости компании, как факторы риска

**37.** Характеристика системы управления рисками

**38.** Характеристики признаков проекта

**39.** Цели и задачи риск-менеджмента.

**40.** Цель и методы управления риском

***ИНСТИТУТ ПРОЕКТНОГО  
МЕНЕДЖМЕНТА И ИНЖЕНЕРНОГО БИЗНЕСА***

**КАФЕДРА УПРАВЛЕНИЯ**

**МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ  
ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ  
«РИСК- МЕНЕДЖМЕНТ В ПРОЕКТНОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ»**

**(Приложение 2 к рабочей программе)**

**Направление подготовки: 38.03.02 «Менеджмент»**

**Профиль: «Логистика»**

**Квалификация (степень) выпускника: бакалавр**

**Форма обучения: очная, заочная**

Королев  
2020

## 1. Общие положения

**Целью** изучения дисциплины является:

- формирование базовых компетенций для подготовки квалифицированных бакалавров в области управления рисками, с использованием полученных знаний и навыков в практической деятельности.

Основными **задачами** дисциплины являются:

- формирование профессионального мышления студентов в контексте реализации функций управления рисками;  
- освоение знаний и практических навыков в области анализа рыночных и специфических рисков;  
- освоение методов снижения уровня рисков в процессе принятия управленческих решений.

## 2. Указания по проведению практических (семинарских) занятий

### 2.1 Указания по проведению практических занятий

#### **Практическое занятие 1.**

Вид практического занятия: смешанная форма практического занятия, сочетающая решение задач и практических ситуаций (кейсов).

**Тема: Введение в дисциплину**

#### **Задача 1**

Руководитель проекта в июле 2019 г. потратил на поиск нужных товаров — качественных и дешевых — (покупка осуществлялась за свои деньги) — 30 ч в месяц. Если бы он покупал первые попавшиеся качественные товары, то тратил бы денег на 25% больше. Руководитель может работать 8 ч ежедневно, а в месяце 30 дней. При окладе 3500 р. в месяц, который он получает в любом случае, и возможности зарабатывать дополнительно в час 25 р. он считает трату времени на поиск товаров рациональной.

Найти двустороннее ограничение на цену «товарной корзины» руководителя в условиях экономии (оптимального риска затрат), если никаких накоплений у него нет.

#### **Задача 2**

В Европе величина спроса на проект строительства жилого дома при неизменных прочих условиях увеличилась на 15% при росте цены на 5%. Как изменилась выручка продавца - строительной фирмы? Ответ дайте в процентах с точностью до двух знаков после запятой.

#### **Задача 3**

Студент N имеет в течение рабочего дня возможность получить работу во множестве мест, где оплата труда сдельная и колеблется от 17 до 20 р. в час. Привлекательность работы в разных местах примерно одинакова. Какова альтернативная стоимость одного часа свободного времени студента в течение рабочего дня?

#### **Задача 4**

Студентка могла получить работу с оплатой от 5 до 10 р. в час. Она выбрала работу менеджера с оплатой 7 р. в час и заключила контракт на год. Какова после

этого упущенная выгода одного часа свободного времени в течение рабочего дня при почасовой оплате труда?

#### **Задача 5**

Студентка имеет возможность получить работу с оплатой от 4 до 8 р. в час в обычное рабочее время с 9 до 18 ч. Других возможностей получить работу она не имеет. Какова альтернативная стоимость одного часа свободного времени в интервале с 8 вечера до 8 утра?

#### **Задача 6**

Студент разработал уникальный проект, позволяющий получать стабильные и высокие доходы при его реализации. Однако у студента нет денег на его реализацию, но деньги нужны и срочно для других целей. Студент публикует в интернете сообщение о продаже проекта.

Трое предпринимателей заинтересовались предложением. Первый готов купить проект за 5000 долл., второй — за 4000 долл., а третий решил попытаться договориться за 3000 долл.

а) Построить шкалу и график спроса.

б) Как должен действовать студент для получения максимального дохода от продажи в сложившихся обстоятельствах? Заинтересованные в покупке предприниматели друг друга не знают.

#### **Задача 7**

Каждый месяц цены растут на 1,5%. Каков ожидаемый уровень инфляции за год?

#### **Задача 8**

Условия заданий:

А). В целях расчета рисков проекта определить, количество среднемесячных постоянных и переменных затрат на участке штамповки в основном цехе № 1 рассматриваемого предприятия при условии, что:

1) затраты на потребляемую энергию прямо пропорциональны продолжительности рабочего времени и составляют условно 10 Мвт. эл. эн. в месяц.

Цена 1 Мвт. эл. эн. условно равна 3000 ед.

2) среднемесячная производительность при сдельной оплате труда одного штамповщика - 20 изделий. Для работы требуются две единицы оборудования. Всего на участке имеется 20 единиц оборудования.

3) Цена единицы оборудования (когда оно приобреталось) — 50 тыс. долларов (курс доллара к рублю определить по диаграмме),

4) срок службы оборудования — 5 лет

5) Предприятие арендует помещение под штамповочный участок.

6) Аренда помещения стоит 4 млн. руб. в месяц. Количество работающих на участке по плану не может превышать 10 человек. Фактически работает 9 человек.

Цена одного изделия после штамповки — 500 руб. Среднемесячная заработная плата одного работающего составляет 20 тыс. р. в месяц без сверхурочных. Средняя месячная оплата одному штаповщику за сверхурочные - 2 тыс. рублей.

Б) Найти оптимальную прибыль штамповочного участка предприятия (при оптимальной численности) рабочих, если сверхурочно они могут трудиться до 0,5 смены за двойную оплату каждого отработанного часа.

Необходимая дополнительная информация для расчета берется из условий задания А).

**В)** В структуре издержек расходы на зарплату составляли 50%, а на транспорт — 20%.

Какова чувствительность себестоимости к изменению каждой из перечисленных статей затрат? Определить понятие: «чувствительность себестоимости» в контексте задания.

**Г) Рабочий** день уменьшился с 8 до 7 ч. На сколько процентов повысилась производительность труда, если при тех же расценках сдельная заработная плата выросла на 5%?

**Д)** В составе издержек расходы на зарплату составляли 30%, а на электроэнергию — 10%. На сколько % изменится себестоимость, если зарплату увеличить на 50%, а расходы на электроэнергию снизить на 40% ?

**Е)** На рассматриваемом предприятии процентная ставка за используемое штамповочное оборудование в час в два раза выше, чем ставка часовой оплаты труда рабочего штамповщика. Используются две единицы подобного оборудования, на котором работают двое рабочих. Может ли предприятие, изменив комбинацию используемых ресурсов, уменьшить затраты, без сокращения выпуска штамповочных изделий?

Кейс-анализ 1.

В сказке «Три поросенка» герои Ниф-Ниф, Нуф-Нуф и Наф-Наф приняли решение построить теплый и прочный дом для защиты от злого Волка. Каждый из поросят, руководствуясь своими идеями, решил разрабатывать свой проект: ленивый Ниф-Ниф начал строить соломенный домик, более предусмотрительный Нуф-Нуф — деревянный, а мудрый Наф-Наф приступил к сооружению кирпичного дома, который в конце концов и спас поросят от волчьих зубов.

Ответьте на следующие вопросы.

1. Какова была внешняя среда каждого проекта?
2. Опишите воздействие факторов внешней среды, которое они оказали на проект в процессе его реализации.
3. Перечислите объективные факторы проекта строительства каждого дома.
4. Назовите субъективные факторы каждого проекта.
5. В чем состоят риски проекта строительства соломенного домика?
6. Каковы специфические риски проекта Нуф-Нуфа?
7. Классифицируйте основные риски проекта Наф-Нафа.

**Ситуация 1.** Руководством компании принято решение о новом проекте: выпуске корпоративного информационного продукта.

Данный продукт призван улучшить имидж компании, стать лицом, представляющим компанию, формируя у потенциального клиента впечатление о ней. Продукт создается не только для внешней среды, но он должен быть направлен и на коллектив своих сотрудников, с целью формирования благоприятных корпоративных отношений, неформальной атмосферы, способствующих дружной работе. На реализацию этого проекта предоставлено 2 месяца. Пожелание руководства компании — реализовать проект в кратчайшие сроки.

**Инструкция:** группа студентов выступает в качестве коллективного риск-менеджера проекта, приглашенного возглавить этот проект.

**Задание: 1.** Сформулировать название информационного продукта.

2. Обосновать инициации проекта (потребности, из-за которых проект образовался).

3. Указать возможные риски проекта, выделить их потенциальные источники.

4. Обосновать основную цель проекта, дать основные характеристики проекта и продукта, существенно важные для идентификации рисков.

5. Дать определения принципам и правилам управления рисками данного проекта.

*Продолжительность занятия- 2/- час.*

### **Практическое занятие 2.**

Вид практического занятия: выполнение ситуационных заданий, кейсов

Тема: **Риск- менеджмент, как система организации и управления**

#### **Задание 1. Структурная декомпозиция работ**

Описание ситуации.

Руководством компании принято решение о выпуске корпоративного фильма.

Корпоративный фильм должен повысить рыночный имидж компании.

По предварительно разработанному плану, предполагается осуществлять съемку, как на территории компании, так и на природе — во время проведения праздничных корпоративных мероприятий.

По окончании производства фильма решено провести его презентацию с приглашением высшего руководства компании.

Для достижения целей проекта необходима реализация 10 задач:

1. Написание сценария. Первый этап работ — длительность — 7 рабочих дней.
2. Съемка интервью с одним из руководителей предприятия. Этот этап может начаться только после окончания первого этапа. Его продолжительность — 4 дня.
3. Подбор актеров. Этот этап может начаться только после написания сценария. Продолжительность этапа 12 дней.
4. Согласование с отделом секретности — выполняется после написания сценария. Продолжительность этапа — 5 дней.
5. Съемка корпоративного праздника на природе. В любой момент после подбора актеров можно приступить к съемкам праздника. На это потребуется 3 дня.
6. Съемка в цехах. После завершения проверки отделом секретности можно приступить к съемкам в производственных цехах предприятия. Это займет 7 дней.
7. Монтаж отснятого материала. После проведения съемки интервью и корпоративного праздника, а также после съемки в цехах можно приступить к монтажу полученного видеоматериала в единый фильм. Монтаж предполагается осуществить в течение 5 дней.
8. Озвучение отснятого материала. Может быть осуществлено сразу же после завершения монтажа. Продолжительность этапа — 4 дня.
9. Проверка отделом секретности. Отдел секретности осуществляет контроль готового фильма непосредственно после монтажа. На это потребуется 3 дня.
10. Презентация фильма руководству компании. Мероприятие является завершающим, к его началу все остальные работы должны быть завершены. Презентация будет проходить в течение одного дня.

**Инструкция:** группа студентов разбивается на временные творческие коллективы (ВТК), каждый коллектив готовит свои предложения, согласно заданию.

#### **Задание:**

1. Построить иерархическую структуру работ в проекте (WBS)
  - По смешанному принципу

- По принципу этапов жизненного цикла.
- 2.Обосновать этапы организации риск- менеджмента по выпуску фильма.
- 3.Обосновать подход к организации риск- менеджмента в фирме при создании фильма.

**Групповое обсуждение:** Участники ВТК предлагают и обосновывают свои выводы.

## **Задание 2. Классификация рисков**

Дан следующий перечень рисков.

- 1) Риск аварии грузового судна во время перевозки груза, ожидаемого компанией.
- 2) Риск слишком резкого снижения курса USD для компании, осуществляющей экспортные операции.
- 3) Риск возникновения сбоев в поставках сырья.
- 4) Риск снижения спроса на продукцию предприятия.
- 5) Риск отвержения рынком нового товара организации.
- 6) Риск потери прибыли в результате снижения рыночных цен на товар.
- 7) Риск просрочки выплаты долга дебитором.
- 8) Риск разрушения складского помещения фирмы в результате стихийного бедствия.
- 9) Риск поражения вирусом компьютерных сетей компании.
- 10) Риск утечки информации, представляющей коммерческую тайну.
- 11) Риск возникновения на рынке нового сильного конкурента.
- 12) Риск потери платежеспособности.
- 13) Риск превышения спросом производственных мощностей предприятия.
- 14) Риск поставки низкокачественных материалов поставщиком (с большой долей брака).
- 15) Риск резкого скачка текучести кадров.
- 16) Риск остановки производства в результате выхода из строя оборудования.
- 17) Риск ухода с рынка основного промышленного потребителя продукции предприятия.
- 18) Риск банкротства банка, обслуживающего организацию.
- 19) Риск отказа инвестора от дальнейшего финансирования проекта в процессе его реализации.
- 20) Риск ухода ведущих специалистов компании.

**Инструкция:** группа студентов разбивается на временные творческие коллективы (ВТК), каждый коллектив готовит свои предложения, согласно заданию по классификации.

**Задание:** каждый из перечисленных рисков отнести к одной из групп, согласно их классификации.

**Групповое обсуждение:** Участники ВТК обосновывают выводы на основе классификационных признаков.

### **Ответить на вопросы:**

- 1.Какие компоненты включает система риск- менеджмента.
- 2.Перечислить системные процессы риск- менеджмента.
- 3.Какие задачи решает система внешнего наблюдения?
- 4.Сущность внешнего контроля в риск- менеджменте.

5. Сущность обратной связи между системой внешнего наблюдения и системой управления риском.

*Продолжительность - 2/2 час.*

### **Практические занятия 3 и 4.**

Вид практического занятия: выполнение ситуационных заданий, кейсов

Тема: **Оценка и анализ рисков**

#### **Задание 1.**

**Инструкция:** Задание выполняется группами студентов (ВТК в количестве 3-5 человек), которые предварительно готовятся к его выполнению на практическом занятии.

Задание состоит из следующих этапов:

#### **I этап**

Необходимо выбрать вид деятельности (из состава предложенных).

1. Малое предприятие, находящееся на одной из стадий развития: формирования, роста, стабилизации или спада.

- Виды хозяйственной деятельности фирмы:
- торгово-закупочная деятельность;
- строительство;
- транспортная деятельность;
- производство комплектующих для ... (свободный выбор, например, для мобильных телефонов).

2. Образовательное учреждение:

- Университет;
- Колледж;

3. Процесс (производства, обучения, например: дистанционное образование «e-learning»).

4. Банковская сфера.

#### **II этап**

1. Разбить деятельность фирмы (рабочий процесс) по функциональным направленностям (не менее 5). Например: производство, маркетинг, финансы, кадры, инновации.

2. По каждой функциональной направленности необходимо выявить экспертным путем 4-5 основных рисков, исходя из специфики отрасли (фирмы/процесса).

Выполняется индивидуально, т.е. каждый студент группы берет на себя идентификацию рисков по одной из функциональных направленностей. Студенты выступают в роли экспертов отрасли.

3. Каждому эксперту, работающему отдельно, предоставляется перечень возможных рисков и предлагается оценить вероятность их наступления, основываясь на следующей системе оценок:

0 – несуществующий риск;

25 – рисковая ситуация вероятнее всего не наступит;

50 – о возможности риска нельзя сказать ничего определенного;

75 – рисковая ситуация вероятнее всего наступит;

100 – рисковая ситуация наступит наверняка.

Затем оценки экспертов (студентов) подвергаются анализу на их противоречивость и должны удовлетворять следующему правилу: максимально допустимая разница между оценками двух экспертов по любому виду риска не должна превышать 50, что позволяет устранить недопустимые различия в оценках экспертами вероятности наступления отдельного риска:  $\max |a_i - b_i| \leq 50$ , где  $a, b$  – векторы оценок каждого из двух экспертов. При трех экспертах должно быть сделано три оценки: для попарного сравнения мнений первого и второго экспертов, второго и третьего;  $i$  – вид оцениваемого риска. Например, если три эксперта дали следующие заключения по одному из рисков:  $A - 25$ ;  $B - 50$ , то в данном случае разности оценок составляют:  $AB = 25$  и  $BC = 25$ , что удовлетворяет условию.

**Необходимо также:**

4. Определить рисковое поле фирмы, например, по следующей примерной структуре:

Рисковое поле фирмы	
Финансовые риски	Весовые коэффициенты
	0
	50
	25
	75
Производственные риски	100
	25
	50
	0
Маркетинговые риски	75
	50
	100
	25
.....	.....

5) Выявить дублирующие рисковые ситуации.

6) Выявить «Корневую», «Узловую», «Результирующую» рисковые ситуации, предварительно разграничив их по оставшимся функциональным направлениям,

7) Определить, в этой связи, задачи риск - менеджмента фирмы.

8) Сделать обобщенный вывод.

**Задача 1.** Фирма производит 100000 шт. изделий типа А. Цена реализации – 2570 руб.;

средние переменные издержки – 1800 руб./шт.; постоянные издержки – 38,5 млн. руб.

(в ценах 2000 г.). Провести анализ чувствительности прибыли фирмы к 10%-ным изменениям основных элементов операционного рычага:

1. Цена изменяется на 10%. Как изменяется прибыль? На сколько единиц продукции можно сократить объем реализации без потери прибыли?

2. Оценить влияние 10-процентного изменения переменных расходов на прибыль.

3. Оценить влияние 10-процентного изменения постоянных расходов на прибыль.

4. Оценить влияние 10-процентного увеличения объема реализации.
5. Дать характеристику возможным рискам, исходя из полученных расчетов.

**Задача 2.** Оценивается вариант вложения финансовых ресурсов объемом  $C = 100000$  руб. Прогнозная оценка возможного убытка  $Y = 33000$  руб. Оценить последствия риска вложения ресурсов.

Найти:

- а) дисперсию;
- б) стандартное среднеквадратическое отклонение наступления рискованных случаев на предприятии, при условии, что фирма имеет следующие показатели фактического наступления рискованных событий:

Годы	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
Факт. наблюдаемое число рискованных случаев, %	8	10	3	12	7	18	12	15	9	?

**Задача 3.** Необходимо выбрать лучший из альтернативных финансовых активов, если имеются следующие характеристики финансовых активов.

Показатель	Вариант А	Вариант В
Цена ценной бумаги (усл. ед.)	12	20
Экспертная оценка доходности, %		
пессимистическая	14	13
Наиболее вероятная	16	17
оптимистическая	18	21
Размах вариации доходности, %	4	8

*Условие решения.* В данных условиях оценить риск каждого из альтернативных финансовых инструментов, если в обоих случаях вероятность наиболее вероятной доходности составляет 60%, а вероятности пессимистической и оптимистической оценок равны и составляют 20% каждый.

*Ответить на вопросы:*

1. Какие базовые финансовые документы необходимо использовать для получения информации с целью управления риском?
2. Охарактеризуйте группы транспортного риска по степени ответственности.
3. Как правильно осуществлять обнаружение рисков при помощи качественного анализа?
4. Какие требования необходимо предъявлять к информации о рисках?
5. Охарактеризуйте экономическую (коммерческую) и политическую неопределенности.

6.Какую информацию о рисках необходимо получать при помощи количественной оценки?

*Продолжительность-4/2 час.*

### **Практическое занятие 5.**

Вид практического занятия: смешанная форма практического занятия, на котором сочетается дискуссия, выполнение ситуационных заданий, задач и кейсов

**Тема: Принятие управленческих решений в условиях неопределенности**

**Задача 1.** Елена И. планирует продажу плакатов для туристов по 3,5 долл. за штуку. Она может приобретать плакаты за полную стоимость. Аренда палатки обойдется в 700 долл. в неделю. От ответов на нижеприведенные вопросы будет зависеть решение Елены относительно расширения своего бизнеса, в частности прием на работу новых работников.

Ответьте на следующие вопросы:

- 1) Каков порог рентабельности?
- 2) Каким станет порог рентабельности, если арендная плата повысится до 1050 долл.?
- 3) Каким будет порог рентабельности, если удастся увеличить цену реализации с 3,5 долл. до 3,85 долл.?
- 4) Каким будет порог рентабельности, если закупочная цена плакатов повысится с 2,1 долл. до 2,38 долл.?
- 5) Сколько плакатов должно быть продано для получения прибыли в сумме 490 долл. в неделю?
- 6) Какую прибыль можно ожидать при различных уровнях продаж?
- 7) Какой запас финансовой прочности имеет бизнес Марии при сумме прибыли 490 долл. в неделю?
- 8) Если Мария М. планирует продавать два вида товара: 400 штук обычных плакатов (цена реализации 3,5 долл., закупочная цена 2,1 долл.) и 500 штук больших плакатов (цена реализации 6 долл., закупочная цена 3,92 долл.), то чему будет равен порог рентабельности каждого из этих товаров и общий порог рентабельности всего предприятия?
- 9) Что больше способствует снижению порога рентабельности и повышению запаса финансовой прочности: торговля одним видом плакатов или двумя?
- 10) сделайте вывод: какое решение примет Елена относительно будущих масштабов своего бизнеса с учетом возможных рисков?

**Задача 2.** Предприятие производит электроплиты, реализуя 400 плит в месяц по цене 250 руб. (без НДС). Переменные издержки составляют 150 руб./шт., постоянные издержки предприятия – 35000 руб. в месяц.

Показатель	На ед. продукции, руб.	%	Долей единицы
Цена реализации	250	100	1
Переменные издержки	150	60	0,6

Валовая маржа	100	40	0,4
---------------	-----	----	-----

Ответить на следующие вопросы:

- 1) Начальник отдела маркетинга полагает, что увеличение расходов на рекламу на 10000 руб. в месяц способно дать прирост ежемесячной выручки от реализации на 30000 руб. Является ли риском повышение расходов на рекламу на перспективу?
- 2) Зам. генерального директора по производству хотел бы использовать более дешевые материалы, позволяющие экономить на переменных издержках по 25 руб. на каждую единицу продукции. Однако начальник отдела сбыта опасается, что снижение качества плит приведет к снижению объема реализации до 350 шт. в месяц. Рискует ли руководство, если переходит на более дешевые материалы?
- 3) Начальник отдела маркетинга предлагает снизить цену реализации на 20 руб. и одновременно 15000 в месяц. Отдел маркетинга прогнозирует в этом случае увеличение объема реализации на 50%. Следует ли одобрить такое предложение?
- 4) Начальник отдела сбыта предлагает перевести своих сотрудников с окладов (суммарный месячный фонд оплаты 6000 руб.) на комиссионное вознаграждение 15 руб. с каждой проданной плиты. Он уверен, что объем продаж вырастет на 15%. Следует ли одобрить такое предложение?
- 5) Начальник отдела маркетинга предлагает снизить отпускную оптовую цену, что бы стимулировать сбыт и довести дополнительный ежемесячный объем оптовых продаж до 150 плит. Какую следует назначить оптовую цену на дополнительную продукцию, чтобы прибыль возросла на 3000 руб.?

**Задача 3.** Фирма изготавливает запасные части к автомобилям и реализует их по 10 руб./шт. Переменные издержки на единицу продукции – 3,6 руб. Квартальный объем продаж – 250000 шт. Постоянные издержки фирмы составляют 975000 руб. Порог рентабельности перейден. Поступает коммерческое предложение продать дополнительно 20000 изделий по 5,25 руб. Выполнение этого заказа связано только с возрастанием переменных издержек на 72000 руб. Постоянные издержки не изменятся.

Следует ли принять предложение?

**Ответить на вопросы:**

1. В чем заключается преимущество параметрического показателя риска перед вероятностным? Что означает понятие «рисковый капитал»?
7. Как правильно разработать и довести до подчиненных план действий в случае критической ситуации возникновения информационных рисков?
2. Как соотносятся между собой понятия «неопределенность» и «риск»?
3. Какие показатели используют для характеристики неопределенности ожидаемого результата некоторой операции? В каких единицах измеряются дисперсия, коэффициент вариации?
8. Какие практические меры используются при управлении информационными рисками?
9. Каким образом следует определять границу между приемлемым и неприемлемым рисками?

4. Каким образом можно получить оценку риска аварии, если в ее анализе участвуют два эксперта: один оценивает степень вероятности аварии на объекте, а другой — ее последствия?
10. При помощи каких показателей определяется доверительный интервал и временной горизонт при оценке (VaR)?
11. Что подразумевают риски неисполнения хозяйственных договоров и селективные риски?

*Продолжительность- 2 /2 час.*

### **Практические занятия 6 и 7.**

Вид практического занятия: смешанная форма практического занятия, на котором сочетается обсуждение презентаций с выступлением студентов и дискуссиями, выполнение ситуационных заданий, кейсов

Тема: **Инструментарий риск-менеджмента**

**Деловая игра «Оценка рисков ценовой политики фирмы».**

**Цель:** получить навык определения антирисковой ценовой политики фирмы;

**Инструкция:** Участники вырабатывают и презентуют аналитические данные о ценовой политике конкурирующих фирм. Формируются общие классификационные признаки и критерии рисков в условиях реализации ценовой политики. Предлагаются меры снижения рисков.

**Предварительные условия.** Участники игры собирают информацию о политике формирования цен конкретной фирмы на товары и характеристику цен на аналогичные товары конкурентов. Дают сопоставимую аналитическую оценку цен и обоснование с позиции рисков. По результатам анализа делаются выводы о рисках ценовой политики фирмы и направлении их снижения.

**Для сбора необходимой информации следует ответить на примерные вопросы:**

1. Каковы цены за товар или услугу на Вашей фирме/на день сбора информации/?
2. Как покупатель рассчитывается за покупку /наличная форма оплаты, безналичная и т. д./?
3. Какие виды скидок предоставляет фирма?
4. Берет ли фирма плату за дополнительные непредвиденные услуги?
5. Когда, и на сколько, фирма в последний раз меняла цены на товары или услуги?
6. Как Ваши клиенты реагируют на цены?
7. Считаете ли Вы сами цены конкурентоспособными?
8. Считаете ли Вы, что если фирма не обслуживает клиентов в кредит, то этим она теряет покупателей?
9. Считаете ли Вы необходимым изменить цены? Если да, то в какую сторону и на сколько?
10. Как к изменению цен отнесутся клиенты?

*Продолжительность- 4 /2 час.*

### **Практическое занятие 8.**

Вид практического занятия: выполнение ситуационных заданий, кейсов  
 Тема: **Прикладные вопросы управления рисками**

**Кейс 1. Риск-анализ инвестиционного проекта методом сценариев**

Имеются три возможных сценария реализации инвестиционного проекта.

Исходные данные:

Сценарии	Наилучший	Вероятный	Наихудший
Вероятности	0,05	0,9	0,05
Тариф (руб.)	370	187,9	187,9
Себестоимость(руб.)	95,40	53,37	81,73
NPV(руб.)	43163,00	14790,00	9634,00

Построение сценариев и расчёт NPV по вариантам осуществлялся с учетом того факта, что себестоимость 1Гкал, вырабатываемой локальной котельной и тариф за централизованное отопление в значительной степени коррелируют друг с другом, поскольку обе эти величины зависят от одних и тех же факторов, как то эксплуатационные расходы и зарплата обслуживающего персонала.

Провести экономико-статистический анализ сценариев и дать ответы на следующие вопросы (заполнить место, где стоит вопросительный знак):

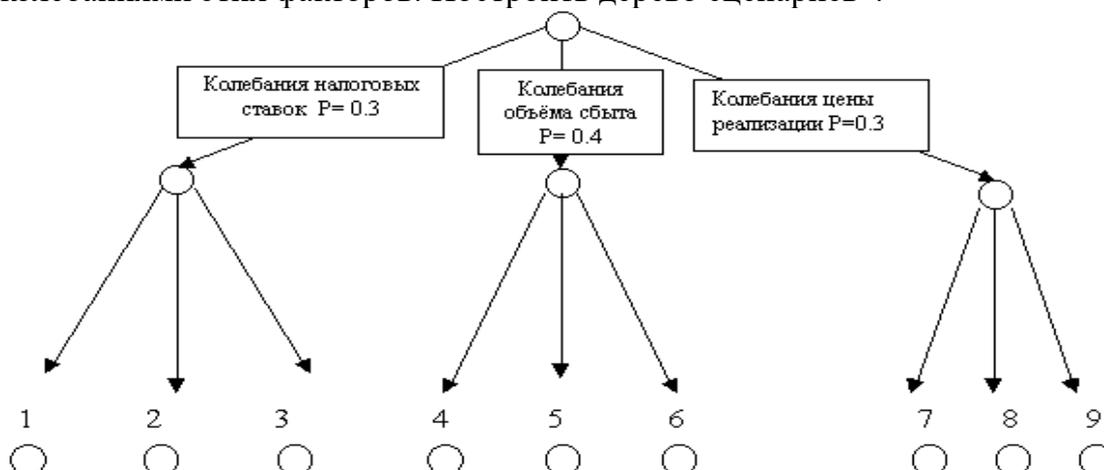
1. Среднее значение NPV составляет?
2. Коэффициент вариации NPV равен?
3. Вероятность того, что NPV будет меньше нуля?
4. Вероятность того, что NPV будет больше максимума равна?
5. Вероятность того, что NPV будет больше среднего на 10 % равна?
6. Вероятность того, что NPV будет больше среднего на 20 % равна?

Указать какие оценки дает данные метод сценария: оптимистические или пессимистические?

Установить ключевые факторы проекта, оказывающие существенное влияние на его эффективность. Для чего провести анализ чувствительности по всем факторам в интервале от -20% до +20%.

В рассматриваемом случае ключевыми факторами будут: ставки налогов; объём сбыта, цена сбыта.

Необходимо проанализировать возможные ситуации, обусловленные колебаниями этих факторов. Построить дерево сценариев”.



**Рисунок 2 - Дерево сценариев**

**Ситуация 1:** Колебания налоговых ставок Вероятность ситуации = 0,3

**Ситуация 2:** Колебания объёма сбыта Вероятность ситуации = 0,4

**Ситуация 3:** Колебания цены сбыта Вероятность ситуации = 0,3

Возможные сценарии развития указанных ситуаций:

**Ситуация 1:** Колебания налоговых ставок Вероятность ситуации = **0,3**

**Сценарий 1:** Снижение налоговых ставок на 20%

Вероятность сценария в рамках данной ситуации = 0,1

Общая вероятность сценария =  $0,1 \times 0,3 = 0,03$

**Сценарий 2:** Налоговые ставки остаются неизменными

Вероятность сценария в рамках данной ситуации = 0,5

Общая вероятность сценария =  $0,5 \times 0,3 = 0,15$

**Сценарий 3:** Повышение налоговых ставок на 20%

Вероятность сценария в рамках данной ситуации = 0,4

Общая вероятность сценария =  $0,4 \times 0,3 = 0,12$

**Ситуация 2:** Колебания объёма реализации Вероятность ситуации = **0,4**

**Сценарий 4:** Снижение объёма реализации на 20%  $P=0,25 \times 0,4=0,1$

**Сценарий 5:** Объёма реализации не изменяется  $P=0,5 \times 0,4=0,2$

**Сценарий 6:** Увеличение объёма реализации на 20%  $P=0,25 \times 0,4=0,1$

**Ситуация 3:** Колебания цены реализации Вероятность ситуации = **0,3**

**Сценарий 7:** Снижение цены реализации на 20%  $P=0,2 \times 0,3=0,06$

**Сценарий 8:** Цена реализации не изменяется  $P=0,5 \times 0,3=0,15$

**Сценарий 9:** Увеличение цены реализации на 20%  $P=0,3 \times 0,3=0,09$

По каждому из описанных сценариев определить NPV (эти значения были рассчитаны при анализе чувствительности).

Ситуация 1.

Ситуация 1		1	
Сценарии	1	2	3
Вероятности	0,03	0,15	0,12
NPV	78 310 414	68 419 353	59 397 846

Ситуация 2.

Ситуация		2	
Сценарии	4	5	6
Вероятности	0,1	0,2	0,1
NPV	48 005 666	68 419 353	88 833 040

Ситуация 3.

Ситуация		3	
Сценарии	7	8	9
Вероятности	0,06	0,15	0,09
NPV	47 901 966	68 419 353	88 936 739

Необходимо сделать общие выводы на основе риск-анализа проекта (заполните место, где стоит вопросительный знак):

1. Наиболее вероятный NPV проекта (68 249 026 тыс. руб.) несколько ниже, чем ожидают от его реализации ?

3. Цена риска ИП в соответствии с правилом “трёх сигм” составляет ? , что превышает наиболее вероятный NPV проекта = ?

Цену риска можно также охарактеризовать через показатель коэффициент вариации (CV). В данном случае  $CV = ?$  Это значит, что на рубль среднего дохода (NPV) от ИП приходится ? возможных потерь с вероятностью равной ?

**Кейс 2.** Предприятие производит электроплиты, реализуя 400 плит в месяц по цене 250 руб. (без НДС). Переменные издержки составляют 150 руб./шт., постоянные издержки предприятия – 35000 руб. в месяц.

Показатель	На ед. продукции, руб.	%	Долей единицы
Цена реализации	250	100	1
Переменные издержки	150	60	0,6
Валовая маржа	100	40	0,4

Ответить на следующие вопросы:

1) Начальник отдела маркетинга полагает, что увеличение расходов на рекламу на 10000 руб. в месяц способно дать прирост ежемесячной выручки от реализации на 30000 руб. Является ли риском повышение расходов на рекламу на перспективу?

2) Зам. генерального директора по производству хотел бы использовать более дешевые материалы, позволяющие экономить на переменных издержках по 25 руб. на каждую единицу продукции. Однако начальник отдела сбыта опасается, что снижение качества плит приведет к снижению объема реализации до 350 шт. в месяц. Рискует ли руководство, если переходит на более дешевые материалы?

3) Начальник отдела маркетинга предлагает снизить цену реализации на 20 руб. и одновременно 15000 в месяц. Отдел маркетинга прогнозирует в этом случае увеличение объема реализации на 50%. Следует ли одобрить такое предложение?

4) Начальник отдела сбыта предлагает перевести своих сотрудников с окладов (суммарный месячный фонд оплаты 6000 руб.) на комиссионное вознаграждение 15 руб. с каждой проданной плиты. Он уверен, что объем продаж вырастет на 15%. Следует ли одобрить такое предложение?

5) Начальник отдела маркетинга предлагает снизить отпускную оптовую цену, что бы стимулировать сбыт и довести дополнительный ежемесячный объем оптовых продаж до 150 плит. Какую следует назначить оптовую цену на дополнительную продукцию, чтобы прибыль возросла на 3000 руб.?

3. Фирма изготавливает запасные части к автомобилям и реализует их по 10 руб./шт. Переменные издержки на единицу продукции – 3,6 руб. Квартальный объем продаж – 250000 шт. Постоянные издержки фирмы составляют 975000 руб. Порог рентабельности перейден. Поступает коммерческое предложение продать дополнительно 20000 изделий по 5,25 руб. Выполнение этого заказа связано только с возрастанием переменных издержек на 72000 руб. Постоянные издержки не изменятся.

Следует ли принять предложение?

Ответить на вопросы:

– В чем заключается преимущество параметрического показателя риска перед вероятностным? Что означает понятие «рисковый капитал»?

– Как правильно разработать и довести до подчиненных план действий в случае критической ситуации возникновения информационных рисков?

– Как соотносятся между собой понятия «неопределенность» и «риск»?

– Какие показатели используют для характеристики неопределенности ожидаемого результата некоторой операции? В каких единицах измеряются дисперсия, коэффициент вариации?

– Какие практические меры используются при управлении информационными рисками?

– Каким образом следует определять границу между приемлемым и неприемлемым рисками?

– Каким образом можно получить оценку риска аварии, если в ее анализе участвуют два эксперта: один оценивает степень вероятности аварии на объекте, а другой — ее последствия?

– При помощи каких показателей определяется доверительный интервал и временной горизонт при оценке (VaR)?

– Что подразумевают риски неисполнения хозяйственных договоров и селективные риски?

*Продолжительность- 2 /- час.*

### 3. Указания по проведению лабораторного практикума

Не предусмотрено учебным планом

### 4. Рекомендации по самостоятельной работе студентов

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Виды СРС
1.	Тема 1. Введение в дисциплину	<b>Подготовка докладов по теме (с презентацией):</b> – Эволюция научных взглядов зарубежных ученых на причины возникновения рисков. – Эволюция научных взглядов российских ученых на причины возникновения рисков
2.	Тема 2. Риск-менеджмент, как система организации и управления	<b>Подготовка докладов по теме (с презентацией):</b> – Системообразующие факторы рисков внешней среды проектной деятельности. – Системообразующие факторы рисков внутренней среды проектной деятельности
3.	Тема 3. Оценка и анализ рисков	<b>Подготовка докладов по теме (с презентацией):</b> Система показателей оценки внутренних и внешних рисков проекта.
4.	Тема 4. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности	<b>Подготовка докладов по теме (с презентацией):</b> Реализация управленческого решения в условиях неопределенности на примере деятельности риск - менеджера фирмы Определение зоны риска в ситуации неопределенности на примере деятельности фирмы
5.	Тема 5. Инструментарий риск-менеджмента	<b>Подготовка докладов по теме (с презентацией):</b> Информационное обеспечение риск- менеджмента Методы идентификация и анализа риска Диверсификация как метод управления риском Методы финансирования рисков Современные методы уклонения от риска

6.	Тема 6. Прикладные вопросы управления рисками	<p><b>Подготовка докладов по теме (с презентацией):</b></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- Система показателей оценки риска в условиях определенности</li> <li>- Система показателей оценки риска в условиях частичной неопределенности</li> <li>- Система показателей оценки риска в условиях полной неопределенности</li> </ul>
----	--	---

## **5. Указания по выполнению контрольных работ**

### **1.1. Общие положения**

Согласно учебному плану освоения дисциплины «Риск- менеджмент в проектной деятельности» студенты по итогам изучения курса должны подготовить контрольную работу, которая защищается перед сдачей зачета с оценкой.

Контрольная работа - это самостоятельное, выполненное под руководством преподавателя, исследование.

При написании контрольной работы студент должен быть знаком с соответствующей литературой по избранной теме, уметь анализировать и излагать свою личную позицию по рассматриваемой проблеме, делать соответствующие выводы и предложения.

В настоящих указаниях приведены цель, задачи, порядок выполнения и защиты, а также примерная тематика, структура и титульный лист контрольной работы.

### **5.2. Цель и задачи контрольной работы**

Контрольная работа по дисциплине «Риск- менеджмент в проектной деятельности» является составной частью учебного процесса.

Выполнение контрольной работы преследует следующие цели:

- 1) развитие у студентов навыков самостоятельной работы с литературными источниками;
- 2) умение самостоятельно анализировать целевой материал;
- 3) развитие умения содержательно и последовательно излагать свои мысли.

Для достижения указанных целей необходимо решение следующих задач:

- изучение литературы, справочных и научных источников, включая зарубежные, по теме контрольной работы;
- уяснение основных положений изучаемой проблемы;
- определение цели, объекта, предмета исследования;
- представление выводов (заключения) по результатам теоретического исследования предмета контрольной работы.

### **5.3. Порядок выполнения контрольной работы**

Процесс выполнения контрольной работы и ее защита включают ряд последовательных этапов: выбор темы контрольной работы; подбор необходимых источников и литературы; определение содержания (структуры) контрольной работы; оформление контрольной работы и ее защита.

#### **5.3.1. Выбор темы**

Кафедра управления рекомендует примерный перечень тем для написания контрольной работы по наиболее важным проблемам управления персоналом. Тематика контрольных работ периодически пересматривается с учетом актуальности и практической значимости исследуемых проблем для экономики страны.

Рекомендуется в контрольную работу включать два вопроса: один теоретический вопрос, второй – практический.

Теоретический вопрос раскрывается на основе использования литературных источников и информации сети интернет.

Практический вопрос выполняется по теме, связанной с деятельностью конкретной организации (фирмы, предприятия). Необходимая информация собирается и анализируется самостоятельно на основе первичных и вторичных источников, включая: собственные наблюдения, соответствующих данных открытой печати, литературных источников, аналитических документов и официальных отчетов.

По согласованию с преподавателем, ведущим дисциплину, студент может изменить выбранную тему, а также согласовать иную тему контрольной работы.

### **5.3.2. Подбор необходимых источников и литературы**

Особое значение в процессе подготовки контрольной работы отводится подбору и изучению специальной литературы и периодических изданий по исследуемой теме. В конце настоящих указаний приведен список рекомендуемой литературы, однако ограничиваться только им было бы неправильно.

### **5.3.3. Структура и содержание контрольной работы**

Минимальный объем контрольной работы без приложений должен составлять 15 страниц.

Нумерация страниц начинается со страницы – содержание - и производится арабскими цифрами (шрифт 10) в верхней части листа справа. Титульный лист включается в общую нумерацию.

Титульный лист контрольной работы выполняется по единому образцу (без номера страницы – приложение А).

Объем разделов контрольной работы рекомендуется обеспечить в следующей композиции разделов:

- введение (до 10 % объема контрольной работы) – 1,5-2,0 листа;
- основная часть – 12-14 листов;
- заключение – 1-2 листа;
- библиографический список – 1-2 листа;
- приложения к контрольной работе в ее объем не включаются.

Контрольная работа должна иметь следующую структуру:

- титульный лист;
- по каждому излагаемому вопросу:
  - содержание (план);
  - введение;
  - основная часть;
  - заключение (выводы и предложения);
- приложения (при необходимости);
- список источников информации (в алфавитном порядке);
- приложения (если имеются).

В процессе подготовки контрольной работы:

- необходимо тщательно изучить литературу и информационные источники по избранной теме;
- проявить при изложении темы максимальную самостоятельность (мера самостоятельности и адекватного понимания содержания раскрываемой темы

является критерием оценки студента); положительным фактором контрольной работы являются собственные суждения по ходу раскрытия содержания темы, умение доказательно аргументировать, опираясь на имеющийся практический опыт и подготовку.

– приведенные в работе наглядные материалы, формулы, схемы должны быть самостоятельно прокомментированы;

– при раскрытии второго вопроса следует исключить механическое копирование учебников, учебных пособий, интернет–ресурсов.

Страницы контрольной работы нумеруются.

Примерный план (содержание) контрольной работы приведен в приложении Б.

При составлении структуры контрольной работы студент может обратиться за консультацией к преподавателю.

Во вводной части студент должен обосновать актуальность избранной темы; провести краткий обзор научных источников (публикаций, учебников, материалов исследований) ученых, занимающихся исследованием темы; сформулировать цель контрольной работы и основные задачи, решаемые в рамках ее реализации. Определить предмет и объект работы.

**Первый вопрос (теоретический) должен** раскрывать тему с позиции достижений современной теоретической научной мысли и включать:

– основной понятийный аппарат;

– отечественные и зарубежные разработки и обоснования по теме контрольной работы;

– отношение автора к изученной и представленной теоретической базе темы, а также его предложения (если таковые имеются);

– обязательное представление выводов по разделу (пункту/части).

**В заключении** делаются обобщающие выводы и дается оценка реального состояния рассматриваемой проблемы.

Все части теоретического раздела контрольной работы должны быть изложены в строгой логической последовательности и взаимосвязи. Содержание работы целесообразно иллюстрировать таблицами, схемами, рисунками, графиками и т.д.

**Список использованных источников** должен включать не менее 7 наименований. Он составляется в алфавитном порядке в следующей последовательности:

– законодательные и нормативные правовые акты располагаются в соответствии с их юридической силой:

– международные законодательные акты;

– Конституция РФ;

– кодексы;

– законы РФ;

– указы Президента РФ;

– акты Правительства РФ;

– акты министерств и ведомств;

– статистические сборники;

– специальная научная отечественная и зарубежная литература (монографии, брошюры, научные статьи и т.п.);

– статистические, инструктивные и отчетные материалы предприятий, организаций и учреждений;

– Интернет-ресурсы.

Библиографическое описание источников информации для оформления списка использованной литературы ведется в соответствии с ГОСТ 7.80-2000 «Библиографическое описание документа. Общие требования и правила составления».

Сведения о книгах (монографии, учебники, справочники и т.п.) должны включать: фамилию и инициалы автора (авторов), название книги, город, издательство, год издания. При наличии трех и более авторов допускается указывать фамилию и инициалы только первого из них и слова «и др.». Наименование места издания необходимо приводить полностью в именительном падеже, допускается сокращение названия только двух городов – Москва (М) и Санкт-Петербург (СПб).

Сведения о статье из периодического издания должны включать: фамилию и инициалы автора, заглавие статьи, наименование издания (журнала), наименование серии, год выпуска, том, номер издания (журнала), страницы, на которых помещена статья.

Например:

Федеральный закон от 19.05.1995 № 82-ФЗ «Об общественных объединениях»//Собрание законодательства Российской Федерации, 1995. - № 21, ст. 1930.

Учебник

Социальная политика. [Текст]: Учебник/ Под общ. Ред. Н.А. Волгина. – 2-е изд. Стереотип – М.: «Экзамен», 2014. - 736 с.

Статья из сборника

Никонова О.В. Роль государства в реализации социальных гарантий в странах с развитой рыночной экономикой. [Текст] //Актуальные проблемы социальной политики в современной России: итоги десятилетия (1991-2001гг.)./Под общ. Ред. Н.А. Волгина. - М.: Изд-во РАГС, 2018. - С.116-123.

Статья из газеты

Храпылина Л. Труд необходимо вывести из социального тупика. [Текст] // Человек и труд. – 2014.-№4.- С.33-34.

**Приложения** (страницы нумеруются и отражаются в содержании, а в объем контрольной работы не включаются) содержат, как правило, дополнительную информационную базу, пояснения. Приложения служат подтверждением или дополнительным аргументом приведенных в тексте данных или материалов.

## **5.4. Объем и порядок оформления контрольной работы**

### **5.4.1. Изложение текстового материала**

Текст контрольной работы должен быть отпечатан на компьютере через полтора межстрочных интервала с использованием шрифта *Times New Roman* 14.

Расстояние от границы листа до текста слева — 30 мм, справа — 10 мм, от верхней и нижней строк текста до границы листа — 20 мм. Абзацы в тексте следует начинать с отступа, равного 1,25 см.

Контрольная работа должна быть написана грамотным литературным языком. Каждый раздел, параграф выделяется в тексте. При этом разделы начинаются с новой страницы.

На все используемые в работе материалы даются ссылки на источник: в тексте после упоминания материала указывается в квадратных скобках номер, под которым он значится в списке использованных источников, и номер страницы, например: [5, с. 42].

Сокращение слов в тексте не допускается, кроме установленных ГОСТ 2.316, ГОСТ Р 21.1101, ГОСТ 7.12. Условные буквенные и графические обозначения должны соответствовать установленным стандартам (ГОСТ 2.105-95). Обозначения единиц физических величин необходимо принимать в соответствии с ГОСТ 8.417, СН 528.

Текст должен быть кратким, четким и не допускать различных толкований. При этом рекомендуется использовать повествовательную форму изложения текста документа, например «применяют», «указывают» и т.п.

#### **5.4.2. Оформление таблиц, рисунков и приложений**

Иллюстрации (фотографии, рисунки, схемы, диаграммы, графики и др.) и таблицы служат для наглядного представления в работе характеристик полученных теоретических и (или) экспериментальных данных и выявленных закономерностей. Не допускается одни и те же результаты представлять в виде иллюстрации и таблицы.

Таблицы и рисунки должны иметь названия и порядковую нумерацию. Цифровой материал, как правило, оформляют в виде таблиц.

*Таблицы* применяют для лучшей наглядности и удобства сравнения показателей. Название таблицы должно отражать ее содержание, быть точным, кратким. Название следует помещать над таблицей (шрифт 14, полужирный, без точек). Знак «№» над таблицами не ставится.

Каждая таблица кратко комментируется.

При переносе части таблицы на другие страницы название помещают только над первой частью таблицы.

Таблицы, за исключением таблиц приложений, следует нумеровать арабскими цифрами сквозной нумерацией.

На все таблицы должны быть приведены ссылки в тексте документа, при ссылке следует писать слово «таблица» с указанием ее номера.

Заголовки граф и строк таблицы следует писать с прописной буквы, а подзаголовки граф – со строчной буквы, если они составляют одно предложение с заголовком, или с прописной буквы, если они имеют самостоятельное значение. В конце заголовков и подзаголовков таблиц точки не ставят. Заголовки и подзаголовки граф указывают в единственном числе.

Разделять заголовки и подзаголовки боковика и граф диагональными линиями не допускается.

Заголовки граф, как правило, записывают параллельно строкам таблицы. При необходимости допускается перпендикулярное расположение заголовков граф.

Головка таблицы должна быть отделена линией от остальной части таблицы.

Высота строк таблицы должна быть не менее 8 мм.

Таблицу, в зависимости от ее размера, помещают под текстом, в котором впервые дана ссылка на нее, или на следующей странице, а при необходимости, в приложении к документу.

Если строки или графы таблицы выходят за формат страницы, ее делят на части, помещая одну часть под другой или рядом, при этом в каждой части таблицы повторяют ее головку и боковик. При делении таблицы на части допускается ее головку или боковик заменять соответственно номером граф и строк. При этом

нумеруют арабскими цифрами графы и (или) строки первой части таблицы.

Слово «Таблица» и ее название указывают один раз над первой частью таблицы, над другими частями пишут слова «Продолжение таблицы» с указанием номера (обозначения) таблицы. *Однако желательно таблицы на другую страницу не переносить.* Для этого переносится часть текста после таблицы в текст перед таблицей, а сама таблица при этом перемещается на следующую страницу.

Если все показатели, приведенные в графах таблицы, выражены в одной и той же единице физической величины, то ее обозначение необходимо помещать над таблицей справа, а при делении таблицы на части — над каждой ее частью.

Графу «Номер по порядку» в таблицу включать не допускается. При необходимости порядковые номера показателей указывают в боковике таблицы перед их наименованием.

Повторяющийся в графе таблицы текст, состоящий из одиночных слов, чередующихся с цифрами, допускается заменять кавычками. Если повторяющийся текст состоит из двух и более слов, то при первом повторении его заменяют словами «То же», а далее кавычками. Ставить кавычки вместо повторяющихся цифр, марок, знаков, математических символов не допускается.

Рисунки могут быть расположены как по тексту контрольной работы, так и в приложении.

По тексту иллюстрации (чертежи, графики, схемы, компьютерные распечатки, диаграммы, фотоснимки) следует располагать непосредственно после текста, в котором они упоминаются впервые, или на следующей странице.

Иллюстрации могут быть в компьютерном исполнении, в том числе и цветные.

На все иллюстрации должны быть даны ссылки.

Иллюстрации, за исключением иллюстрации приложений, следует нумеровать арабскими цифрами сквозной нумерацией. Если рисунок один, то он обозначается «Рисунок 1». Слово «рисунок» и его наименование располагают посередине строки. Слово «Рисунок» и наименование помещают после пояснительных данных и располагают следующим образом: Рисунок 1 — Структура управления ООО «Цветочек».

Иллюстрации, таблицы, текст, вспомогательного характера допускается давать в виде *приложений*. Приложение оформляют как продолжение контрольной работы на последующих его листах. В тексте на все приложения должны быть даны ссылки, например: «... в приложении В».

Каждое приложение следует начинать с новой страницы с указанием наверху посередине страницы слова «Приложение» и его обозначения. Приложение должно иметь заголовок, который записывают симметрично относительно текста с прописной буквы отдельной строкой.

Приложения обозначают заглавными буквами русского алфавита, начиная с А, за исключением букв Ё, З, Й, О, Ч, Ъ, Ы, Ь. После слова «Приложение» следует буква, обозначающая его последовательность. Если в работе одно приложение, оно обозначается «Приложение А».

## **5. Консультации в процессе подготовки контрольной работы**

В процессе выполнения контрольной работы студент может получить консультации преподавателя курса дисциплины. Число таких консультаций строго не регламентировано. Однако, с учетом количества студентов в обучаемых группах, а также объема реальной нагрузки преподавателя, представляются возможными 1-2

консультации.

### **5.6. Сроки и порядок сдачи контрольной работы на проверку**

Продолжительность выполнения контрольной работы не может быть менее двух недель.

Оформленная и подписанная студентом с указанием даты выполнения контрольная работа в установленный срок представляется для ее проверки.

Окончательный срок сдачи контрольной работы на проверку определяется руководителем.

Целью проверки контрольной работы преподавателем является определение ее соответствия предъявляемым требованиям и степени готовности к защите.

### **5.7. Порядок и сроки защиты контрольной работы**

В процессе защиты контрольной работы ее автор в сжатой форме излагает: актуальность темы, цель, задачи, этапы и результаты выполнения. По завершению изложения студентом сущности и результатов выполнения контрольной работы преподаватель уточняет отдельные аспекты вопросами по теме, а после их выяснения - подводятся итоги защиты.

Контрольная работа оценивается - «зачет» / «незачет»

### **5.8 Примерная тематика контрольных работ**

Примерная тематика контрольных работ приведена в п.4.1 Приложения 1 рабочей программы дисциплины

## **Приложение А Титульный лист контрольной работы**



Государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
Московской области

**ТЕХНОЛОГИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ**

**ИНСТИТУТ ПРОЕКТНОГО МЕНЕДЖМЕНТА  
И ИНЖЕНЕРНОГО БИЗНЕСА**

**КАФЕДРА УПРАВЛЕНИЯ**

**Контрольная работа**

по дисциплине «Риск- менеджмент в проектной деятельности»

Вопрос 1 - Риски и пути их снижения в организационной системе управления

Вопрос 2 - Риски и пути их снижения в организационной системе управления (на примере ООО «Кия - 1»)

Выполнил студент(ка) \_- го курса  
группы \_\_-

\_\_\_\_\_  
(Ф.И.О.)

Дата выполнения \_\_\_\_\_

Проверил преподаватель

\_\_\_\_\_  
(уч. степень, уч. звание, Ф.И.О.)

Дата проверки \_\_\_\_\_

Дата защиты \_\_\_\_\_

Королев 202\_\_

## **Приложение Б**

### **Примерная структура контрольной работы**

#### **Содержание**

<b>Вопрос 1 - Риски и пути их снижения в организационной системе управления</b>	
Введение .....	3
1 . Понятие и виды рисков.....	4
2 .....	6
3 .....	11
Заключение ..	12
Список использованных источников	.13

#### **Вопрос 2 - Риски и пути их снижения в системе управления (на примере ООО «МН – 1»)**

Введение. Краткая характеристика организации.....	14
1 ..... Идентификация рисков в системе управления предприятием.....	16
1 ..... Качественная оценка рисков .....	18
2 ..... Методы снижения рисков.....	24
Заключение.....	25
Список использованных источников.....	27

## 2. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

### Основная литература:

1. Управление рисками организации: Учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 153 с.: 60x90 1/16 + ( Доп. мат. znanium.com). - (Высшее образование: Бакалавриат). (обложка) ISBN 978-5-16-010203-0, <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=475625>

2. Риск-менеджмент: Учебное пособие / Фомичев А.Н., - 4-е изд. - М.: Дашков и К, 2016. - 372 с. ISBN 978-5-394-02676-8  
<http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=937403>

### Дополнительная литература:

1. Оценка рисков в проектном менеджменте: учебное пособие / Е.И. Капустина, О.П. Григорьева, Ю.С. Скрипниченко, С.А. Молчаненко, М.Г. Барсуков. - Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет, 2017. - 152 с. : ил. - Библиогр. В кн.  
URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=484918>

2. Алексашкина, Е.И. Антикризисное управление на предприятии [Электронный ресурс]: учебное пособие / Е.И. Алексашкина, В.Л. Василёнок, В.В. Негреева. — Электрон. дан. — Санкт-Петербург : НИУ ИТМО, 2015. — 92 с. — Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/91503>.

## 7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «интернет», необходимых для освоения дисциплины

### Интернет-ресурсы:

1. <http://www.risk-online.ru/about> . Журнал «РИСК: Ресурсы, Информация, Снабжение, Конкуренция»
2. <http://www.riskovik.com/journal/>. Журнал «Рисковик»
3. [www.erisks.com](http://www.erisks.com) - сайт компании ERisk. Словарь, энциклопедия, статьи, касающиеся риск-менеджмента.
4. [www.riskmetrics.com](http://www.riskmetrics.com) - сайт компании RiskMetrics (JP Morgan). Описание методик.
5. [about.reuters.com/risk/risklibrary/](http://about.reuters.com/risk/risklibrary/) - материалы по управлению рисками Reuters.
6. [www.fast.anu.ru/menshikov/](http://www.fast.anu.ru/menshikov/) - статьи, касающиеся проблем рыночных рисков.
7. [www.bashedu.ru/konkurs/bakirov/aug/uprav.htm](http://www.bashedu.ru/konkurs/bakirov/aug/uprav.htm) - сборник статей по управлению рыночными рисками.
8. [www.riskman.ru](http://www.riskman.ru) - сайт Института Управления Рисками при Государственном Университете Управления.
9. [koshechkin.narod.ru/risk.html](http://koshechkin.narod.ru/risk.html) - количественный анализ рисков в инвестиционном проектировании.

10. [www.geocities.com](http://www.geocities.com) - информация по валютным рискам.
11. [http://studopedia.net/9\\_84529\\_lektsiya--prinyatie-resheniy-v-usloviyah-neopredelennosti.html](http://studopedia.net/9_84529_lektsiya--prinyatie-resheniy-v-usloviyah-neopredelennosti.html) - Технология принятия управленческих решений в условиях неопределённости.
12. <http://consulting.1c.ru/journal-article.jsp?id=401> «Управляем предприятием» (электронный журнал).
13. <http://grebennikon.ru/journal-23.html> -«Управление финансовыми рисками» (электронный журнал)

## **7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети**

### **Интернет-ресурсы:**

1. [www.biblioclub.ru](http://www.biblioclub.ru)
2. [www.polpred.ru](http://www.polpred.ru)
3. [www.window.edu.ru](http://www.window.edu.ru)
4. [www.rucont.ru](http://www.rucont.ru)
5. [www.znaniyum.com](http://www.znaniyum.com)
6. [www.e.lanbook.com](http://www.e.lanbook.com)
7. [www.proquest.com](http://www.proquest.com)

## **8. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине**

### **Перечень программного обеспечения.**

Материально-техническое обеспечения дисциплины включает в себя:

- мультимедийную аудиторию для чтения лекций-презентаций, подготовленных с использованием Microsoft Office PowerPoint;
- Microsoft Office PowerPoint, Microsoft Office Word, Microsoft Office Excel для выполнения домашних заданий, оформления контрольных работ;
- доступный для студента выход в Интернет с целью поиска современной информации в соответствии с тематикой дисциплины.

### **Информационные справочные системы:**

1. Консультант Плюс