

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ПОВОЛЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ТЕХНОЛОГИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ



УТВЕРЖДАЮ
Декан ФУП

УТВЕРЖДАЮ /Н.И. Ларионова/
(Ф.И.О. декана (директора института))

30.06.2021 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б.1.1.26 Управленческие решения и риск-менеджмент

(код и наименование дисциплины по учебному плану)

Направление подготовки
(специальность)

38.03.02 Менеджмент

Квалификация выпускника

Бакалавр

(бакалавр/магистр/специалист)

Направленность

Менеджмент организации

Курс 3, 4

Семестр 5, 6, 7

Распределение учебного времени

Трудоемкость по учебному плану	252 / 7	часов/зачетных единиц
Лекции	12	часов
Лабораторные работы	-	часов
Практические занятия	14	часов
Иная контактная работа	-	часов
Всего контактной работы (без учета экз.)	26	часов
Контактная работа по экзамену	6	часов
Курсовой проект (работа)	-	семестр
Самостоятельная работа обучающихся (без учета экз.)	190	часов
Самостоятельная работа по подготовке к экзамену	30	часов
Экзамен	7	семестр
Зачет	6	семестр
БРК, ДЗ	-	семестр

(год)

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО направления подготовки (специальности) 38.03.02 Менеджмент

Программу составили:

доцент	МиБ	СОГЛАСОВАНО	О.М. Репина
(должность)	(кафедра)		(И.О. Фамилия)

РАССМОТРЕНА и ОДОБРЕНА на заседании кафедры, за которой закреплена дисциплина
Кафедра менеджмента и бизнеса

		(наименование кафедры)	
21.06.2021	протокол №	9	
(дата)			
Заведующий кафедрой	СОГЛАСОВАНО	В.В. Двоеглазов	
		(И.О. Фамилия)	

Рабочая программа СОГЛАСОВАНА с факультетом (институтом), выпускающей(ими) кафедрой(ами).

СООТВЕТСТВУЕТ действующей ОП.

Заведующий кафедрой	СОГЛАСОВАНО	В.В. Двоеглазов
		(И.О. Фамилия)

Председатель методической комиссии факультета (института), в который входит выпускающая кафедра

СОГЛАСОВАНО	О.М. Репина
	(И.О. Фамилия)

Эксперт(ы): Мокеичев Алексей Николаевич, Директор ООО "Принтекс"

Рабочая программа проверена и зарегистрирована в УМЦ 01.07.2021 г.

Специалист учебно-методического центра СОГЛАСОВАНО /Т.А. Смирнова/

Раздел 1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины является достижение планируемых результатов обучения, соответствующих установленным в ОПОП индикаторам достижения компетенций:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения
1. ОПК-3 Способен разрабатывать обоснованные организационно-управленческие решения с учетом их социальной значимости, содействовать их реализации в условиях сложной и динамичной среды и оценивать их последствия	ОПК-3.1 Разрабатывает организационно-управленческие решения стратегических и оперативных задач как в целом на уровне организации и ее подразделений, так и в отдельных функциональных областях менеджмента.	знания: виды организационно-управленческих решений и методы их разработки умения: умеет разрабатывать обоснованные организационно-управленческие решения с учетом их социальной значимости, содействовать их реализации в условиях сложной и динамичной среды навыки: владеет навыками оценки ожидаемых результатов и последствий реализации организационно-управленческих решений
	ОПК-3.2 Выявляет и оценивает рыночные и специфические риски, ожидаемые результаты и последствия организационно-управленческих решений с учетом их социальной значимости и реализации в условиях сложной и динамической среды.	знания: методологические и организационно-экономические аспекты управления риском: классификацию рисков; методы оценки степени рисков; способы снижения степени рисков умения: проводить комплексное исследование рисков любого бизнес-процесса организации, выявлять, анализировать и оценивать риски; в результате проведенных исследований находить способы снижения риска и неопределенности; использовать полученные результаты при принятии организационно-управленческих решений навыки: владеет навыками принятия организационно-управленческих решений в условиях риска и неопределенности; разработки мероприятий по управлению рисками совместно с ответственными за риск сотрудниками организации, ответственными за эффективную реализацию бизнес-процессов; мониторинга рисков и мониторинга мероприятий по воздействию на риски; определению реестров рисков, построение карты рисков

	ОПК-3.4 Разрабатывает организационно-управленческие решения для планирования, организации и реализации операционной деятельности.	<p>знания: теоретические основы разработки организационно-управленческих решений; современные концепции теории разработки и принятия организационно-управленческих решений; особенности принятия организационно-управленческих решений; методы поиска решения и его внедрения с позиции социальной значимости принимаемых решений</p> <p>умения: оприменять в практической деятельности знания в области разработки управленческих решений; находить и внедрять управленческие решения с позиции социальной значимости принимаемых решений; идентифицировать проблемы и формировать проект управленческого решения; оценивать результаты принятого управленческого решения</p> <p>навыки: владеет навыками сценарного анализа, оценки рисков и оптимизации; навыками поиска решения и его внедрения с позиции социальной значимости принимаемых решений; методами разработки организационно-управленческого решения; навыками оценки результатов управленческого решения</p>
2. ПК-2 Способен участвовать в проведении аудита компании, подготовке финансовых и инвестиционных решений, направленных на рост ценности бизнеса	ПК-2.1 Понимает состав инвестиционных и финансовых решений компании, структуру и принципы формирования основных финансовых политик компании, основные концепции финансового менеджмента, критерии принятия финансовых решений в условиях неопределенности.	<p>знания: виды управленческих решений, процесс принятия решений, методы оптимизации управленческих решений; виды финансовых рисков и методы их снижения в принятии инвестиционных и финансовых решений</p> <p>умения: принимать эффективные финансовые решения в обеспечении и развитии бизнеса компании; алгоритм построения финансовых решений;</p> <p>навыки: владеет навыками определения экономической эффективности финансовых решений организации; навыками использования полученной информации для принятия эффективных финансовых решений</p>

(компаний)	ПК-2.4 Проводит идентификацию и оценку рисков внешней и внутренней среды организации, предлагает способы снижения рисков, анализирует влияние финансовых и инвестиционных решений на риски и ценность компании.	<p>знания: классификацию рисков внешней и внутренней среды организации, методы управления рисками, методы факторного анализа влияния финансовых решений на оценку ценности компании</p> <p>умения: умеет идентифицировать и систематизировать риски, проводить расчеты оценки рисков статистическим экспертным методом, проводить анализ рисков и разрабатывать программу мероприятий по управлению рисками</p> <p>навыки: владеет навыками анализа риска с использованием различных методов, разработки мероприятий по управлению выявленными рисками; проводить анализ влияния принятых финансовых и инвестиционных решений на оценку стоимости бизнеса</p>
------------	---	--

Раздел 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина относится к обязательной части ОПОП.

Дисциплина является обязательной

Для продолжения формирования заявленных компетенций необходимы знания предшествующих дисциплин: Инвестиционный менеджмент (ОПК-3), Стратегический менеджмент и управление изменениями (ОПК-3), Концепция социальной ответственности и этика бизнеса (ОПК-3), Операционный менеджмент и управление затратами (ОПК-3), Финансовый менеджмент (ПК-2), Инвестиционный менеджмент (ПК-2), Фискальный менеджмент (ПК-2), Современные бизнес-модели и анализ бизнеса (ПК-2), Антикризисное управление (ПК-2); практик: Производственная практика. Технологическая (проектно-технологическая) практика (ПК-2)

Изучаемая дисциплина является основой для продолжения формирования указанных компетенций в следующих дисциплинах: 1С:Предприятие (ПК-2), Экономические пакеты прикладных программ (ПК-2); практиках: Преддипломная практика (ОПК-3), Преддипломная практика (ПК-2); государственной итоговой аттестации в форме: Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена (ОПК-3), Выполнение и защита выпускной квалификационной работы (ОПК-3), Выполнение и защита выпускной квалификационной работы (ПК-2)

Раздел 3. ОПИСАНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ ТЕХНОЛОГИЙ

Для формирования заявленных компетенций используются методологические технологии, реализующие деятельностный, личностно-ориентированный, практико-ориентированный подходы.

Основными стратегическими технологиями являются: лекционные занятия, практические занятия, процедуры самообучения

На достижение конкретных целей обучения направлены применяемые тактические технологии: case-study, задания, классическая лекция, лекция с элементами мозгового штурма

Раздел 4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

5 семестр

Виды и темы занятий	Количество часов	Формируемые компетенции
Управленческие решения в системе менеджмента	72	ОПК-3, ПК-2
Лекция. Понятие управленческих решений, место управленческих решений в управлении. Классификация управленческих решений.	2	
Лекция. Руководитель в управлении: возможности и ограничения. Состав основных личностных характеристик, влияющих на разработку и принятие решений.	2	
Практическое занятие. Принятие решений в производственных ситуациях	2	
Практическое занятие. Модели методы подготовки и принятия управленческих решений	2	
Задания для самостоятельной работы, в том числе выполнение Изучение лекционного материала и подготовка к текущему контролю, выполнение домашнего задания, работа с учебной и учебно-методической литературой, изучение дополнительного материала. Информационное обеспечение принятия управленческих решений. Исследование качеств лица, принимающего решения. Принятие решения о замещении должности руководителя. Принятие решений в конфликтных ситуациях.	64	
Иная контактная работа:	0	

6 семестр

Виды и темы занятий	Количество часов	Формируемые компетенции
Теоретические основы риск-менеджмента	72	ОПК-3, ПК-2
Лекция. Сущность, содержание и виды рисков в предпринимательской деятельности	2	
Лекция. Сущность и содержание риск-менеджмента. Организация процесса управления рисками на предприятии	2	
Практическое занятие. Кейс «Исследование рисков в деятельности предприятия». Выявление факторов риска, качественная оценка рисков, способы и приемы снижения риска	2	
Практическое занятие. Выбор управленческих решений, на основе критериев используемых в процессе принятия решений в условиях риска и неопределенности: Решение задач	2	

Задания для самостоятельной работы, в том числе выполнение Изучение лекционного материала и подготовка к текущему контролю, выполнение домашнего задания, работа с учебной и учебно-методической литературой, изучение дополнительного материала. Виды рисков в предпринимательской деятельности. Классификация рисков.Выявление рисков в деятельности предприятия и при реализации инвестиционного и инновационного проекта. Структурные диаграммы. Анализ финансовой и управленческой отчетности. Построение профиля рисков. Принятие решений в условиях риска и неопределенности	64	
Иная контактная работа:	0	

7 семестр

Виды и темы занятий	Количество часов	Формируемые компетенции
Методология риск-менеджмента	72	ОПК-3, ПК-2
Лекция. Методы анализа риска и неопределенности при реализации инновационных проектов. Методы оценки степени риска. Интегральная оценка риска	2	
Лекция. Статистическая оценка риска. Решение задач. Экспертная оценка риска. Построение карты риска.	2	
Практическое занятие. Методы управления рисками. Страхование как основной прием управления рисками.	2	
Практическое занятие. Разработка стратегии управления рисками. Оценка эффективности стратегии риск-менеджмента.	2	
Практическое занятие. Разработка программы управления рисками на предприятии	2	
Задания для самостоятельной работы, в том числе выполнение Изучение лекционного материала и подготовка к текущему контролю, выполнение домашнего задания, работа с учебной и учебно-методической литературой, изучение дополнительного материала. Анализ чувствительности. Анализ безубыточности. Проверка устойчивости. Анализ сценариев развития. Дерево решений. Сравнение вариантов инновационных проектов на основе различных методов анализа риска. Разработка эффективной стратегии управления рисками на предприятии.Расчет бюджета мероприятий по управлению рисками. Оценка эффективности методов управления риском. Методика анализа экономической эффективности страхования и само-страхования. Страховая премия и расчет стоимости предприятия. Фор-мирование фонда риска	62	
Иная контактная работа:	0	
Подготовка к экзамену	30	
Проведение экзамена	6	

Раздел 5. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Изучение дисциплины рекомендуется начать с ознакомления с рабочей программой, ее структурой и содержанием разделов. Учебный материал структурирован, изучение дисциплины осуществляется в тематической последовательности. **Занятия лекционного типа** дают систематизированные знания по дисциплине,

концентрируют внимание на наиболее сложных и важных вопросах. Во время лекционных занятий рекомендуется вести конспектирование учебного материала; обращать внимание на формулировки и категории, раскрывающие суть проблемы, явления или процесса; зафиксировать выводы и практические рекомендации. Подготовка к занятиям семинарского типа включает ознакомление с планом практического занятия; работу с конспектом лекций, выполнение домашнего задания, работу с учебной и учебно-методической литературой, научными изданиями и электронными образовательными ресурсами, рекомендованными рабочей программой дисциплины.

Содержание **самостоятельной работы** определяется рабочей программой дисциплины, оценочными и методическими материалами, заданиями и указаниями преподавателя. Самостоятельная работа может осуществляться в аудиторной и внеаудиторной формах. Эффективным средством осуществления самостоятельной работы является электронная информационно-образовательная среда университета, которая обеспечивает доступ к образовательной программе, рабочей программе дисциплины, к электронным библиотечным системам, профессиональным базам данных и информационным справочным системам.

Периодичность проведения, формы текущего контроля успеваемости, система оценивания хода освоения дисциплин представлены в рабочей программе. Формой промежуточной аттестации по дисциплине является зачет в 6 семестре и экзамен в 7 семестре.

Раздел 6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ И УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1. Учебно-методическое обеспечение

№№ п/п	Список используемой литературы	Количество экземпляров печатных изданий, имеющих в библиотеке, или электронный адрес издания (ресурса) в сети Интернет
УЧЕБНЫЕ, УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКИЕ И НАУЧНЫЕ ИЗДАНИЯ		
1.	Разработка программы управления рисками [Текст] : методические указания к выполнению расчетно-графической работы по дисциплине "Риск-менеджмент" для студентов направления полготовки 38.03.02 "Менеджмент" / М-во науки и высш. образования Рос. Федерации, ФГБОУ ВО "Поволж. гос. технол. ун-т"; составители А. П. Суворова, О. М. Репина. Йошкар-Ола: ПГТУ, 2018. - 51 с. Экземпляры: всего 19.	19 / https://portal.volgatech.net/books/Suvorova_Razrabotka_programmi_upravlenia_riskami_2018.pdf
2.	Риск-менеджмент инвестиционного проекта [Текст] : [учеб. для студентов вузов по экон. специальностям] / [М. В. Грачева и др.] ; под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина. М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2009. - 544 с. ISBN 978-5-238-01506-4. Экземпляры: всего 10.	10
3.	Репина, Ольга Михайловна. Риск-менеджмент [Текст] : практикум : [по направлениям подготовки "Менеджмент", "Инноватика" и др.] / О. М. Репина; М-во образования и науки Рос. Федерации, ФГБОУ ВО "Поволж. гос. технол. ун-т". Йошкар-Ола: ПГТУ, 2017. - 119 с. ISBN 978-5-8158-1803-3. Экземпляры: всего 36.	36 / https://portal.volgatech.net/books/Repina_risk_menedzhment_2017.pdf
4.	Суворова, Алевтина Павловна. Риск-менеджмент [Текст] : учебное пособие : [по направлению подготовки	53 / https://portal.volgatech.net/b

	"Экономика и управление"] / А. П. Суворова, О. М. Репина; М-во науки и высш. образования Рос. Федерации, ФГБОУ ВО "Поволж. гос. технол. ун-т". Йошкар-Ола: ПГТУ, 2018. - 175 с. ISBN 978-5-8158-2036-4. Экземпляры: всего 53.	ooks/Suvorova_Risk_menedzment_2018.pdf
5.	Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учебник для бакалавров / Фомичев А. Н. 9-е изд. Москва: Дашков и К, 2022. - 372 с. ISBN 978-5-394-04273-	https://e.lanbook.com/book/277496
6.	Антонов, Геннадий Дмитриевич. Управление рисками организации [Текст] : учебник : [для студентов высших учебных заведений, обучающихся по направлению подготовки 38.03.02 "Менеджмент" (профиль "Производственный менеджмент"), по магистерской программе "Производственный менеджмент"] / Г. Д. Антонов, О. П. Иванова, В. М. Тумин. Москва : ИНФРА-М, 2019. - 151, [1] с. ISBN 978-5-16-013060-6. Экземпляры: всего 5.	5
7.	Рахимова, Н. Н. Управление рисками, системный анализ и моделирование [Электронный ресурс] : Учебное пособие / Рахимова Н. Н. Оренбург: Оренбургский государственный университет, ЭБС АСВ, 2016. - 191 с. ISBN 978-5-7410-1538-4.	http://www.iprbookshop.ru/69961
8.	Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности [Электронный ресурс] : учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. 3-е изд. Москва: Дашков и К, 2021. - 418 с. ISBN 978-5-394-04018-4.	https://e.lanbook.com/book/229964
9.	Балдин, К. В. Управленческие решения [Электронный ресурс] : учебник / Балдин К. В., Воробьев С. Н., Уткин И. Б. 10-е изд., стер. Москва: Дашков и К, 2022. - 496 с. ISBN 978-5-394-03532-6.	https://e.lanbook.com/book/277637
10.	Юкаева, В. С. Принятие управленческих решений [Электронный ресурс] : учебник для бакалавров / Юкаева В. С., Зубарева Е. В., Чувикова В. В. Москва: Дашков и К, 2016. - 324 с. ISBN 978-5-394-01084-2.	https://e.lanbook.com/book/93383
ЭЛЕКТРОННЫЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ РЕСУРСЫ		
1.	Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU	http://elibrary.ru
2.	Научная электронная библиотека «Киберленинка»	http://cyberleninka.ru
3.		http://
ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ БАЗЫ ДАННЫХ И ИНФОРМАЦИОННЫЕ СПРАВОЧНЫЕ СИСТЕМЫ		
1.		http://
ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ БАЗЫ ДАННЫХ И ИНФОРМАЦИОННЫЕ СПРАВОЧНЫЕ СИСТЕМЫ		
1.	Справочно-правовая система Консультант+	http://www.consultant.ru
2.	Информационно-правовой портал Гарант	http://www.garant.ru

6.2. Материально-техническая база и программное обеспечение

№№ п/п	Аудитории для проведения учебных занятий, самостоятельной работы и проведения государственной итоговой аттестации	Перечень основного оборудования	Программное обеспечение
1.	412 (I)	Проектор мультимедийный Hitachi CP-X2511 N (1), Комплект учебной мебели (1)	Microsoft Windows Enterprise, Справочная правовая система "Консультант Плюс", Microsoft Office Standard, Агент Dr.Web, Комплект ПО для решения основных пользовательских задач, Microsoft Project Professional, Project Expert 7.55 Tutorial, БЭСТ-Маркетинг
2.	515 (I)	Мультимедийный проектор Hitachi CP-X440 (1), ПК Моноблок RAMEC GALE Custom 21,5"/i3-3240/H61M/4DDR3/500SATA3/клав.,мышь (29), Комплект учебной мебели (1)	Microsoft Windows Enterprise, Справочная правовая система "Консультант Плюс", Microsoft Office Standard, Агент Dr.Web, Комплект ПО для решения основных пользовательских задач, Microsoft Project Professional, Project Expert 7.55 Tutorial, БЭСТ-Маркетинг

Раздел 7. ФОРМЫ КОНТРОЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ/ ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Критерии оценивания индикаторов достижения компетенций направлены на:

- усвоение теоретического материала (объем знаний, глубина усвоения), предусмотренного рабочей программой;
- умение излагать материал (четкость, грамотность изложения материала, точность и полнота воспроизведения учебного материала);
- умение применять теоретические знания при решении практических заданий.

Шкала оценивания представлена ниже.

Уровень сформированности элементов компетенции	Критерии оценивания	Шкала оценивания
Пороговый уровень	Обучающийся имеет знания основного материала, проявляет умение логично его излагать, но может допускать неточности в изложении материала, недостаточно правильные формулировки, испытывает затруднения в выполнении практических заданий.	удовлетворительно

Продвинутый уровень	Обучающийся твердо знает программный материал, излагает его грамотно и по существу, не допускает существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения	хорошо
Высокий уровень	Обучающийся глубоко и прочно усвоил программный материал, грамотно и логически стройно его излагает, дает исчерпывающие ответы на поставленные вопросы. В ответе тесно увязывается теория с практикой, при этом обучающийся не затрудняется с ответом при видоизменении задания, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, показывает знакомство с монографической литературой, периодическими изданиями, правильно обосновывает принятые решения, свободно владеет разносторонними навыками, приемами выполнения практических работ	отлично

7.1. Промежуточная аттестация обучающихся

Промежуточная аттестация обучающихся направлена на оценивание результатов обучения по дисциплине (модулю) и проводится с использованием фондов оценочных средств.

Примеры типовых контрольных заданий из базы фонда оценочных средств по образовательной программе.

Тесты к модулю "Управленческие решения"

1. Что такое решение в общем виде?

- любой результат мыслительной деятельности человека.
- действия руководителя в рамках своих функций.
- распоряжение руководителя, поддержанное коллективом.

2. Управленческие решения как вид деятельности — это:

- описание предполагаемых действий управляющей системы по отношению к управляемой;
- комплекс работ, связанных с подготовкой, выбором и принятием оптимального решения;
- обязанность лица, принимающего решение.

3. Управленческое решение — это:

- воздействие управляющей системы на управляемую;
- результат целесообразной деятельности субъекта управления, направленный на

разрешение определенной ситуации;

3. процесс установления цели.

4. На каком этапе разработки управленческого решения происходит процесс диагностики ситуации

1. подготовка решения
2. разработка решения
3. принятие решения
4. реализация решения

5. На каком этапе разработки управленческого решения происходит процесс генерирования альтернативных вариантов

1. подготовка решения
2. разработка решения
3. принятие решения
4. реализация решения

6. На каком этапе разработки управленческого решения происходит процесс разработки сценариев развития ситуации

1. подготовка решения
2. разработка решения
3. принятие решения
4. реализация решения

7. Какие из перечисленных условий соответствуют вероятностным решениям?

1. условия определенности.
2. условия риска.
3. условия неопределенности.
4. условия риска и неопределенности.

8. Как называется решение, принятое по заранее определенному алгоритму?

1. стандартное.
2. хорошо структурированное.

3. формализованное.
4. детерминированное.

9. Какие из перечисленных методов разработки управленческих решений относятся к группе методов исследования операций?

1. метод теории игр.
2. метод разработки сценария.
3. метод Дельфи.
4. метод управления запасами.
5. метод линейного программирования.

Тесты к модулю "Риск-менеджмент"

1. Риск –это:
 - а) опасность потерь;
 - б) вероятность выигрыша;
 - в) вероятная опасность потерь.
2. Падение котировок на рынке ценных бумаг – это:
 - а) внешне непредсказуемый риск;
 - б) внешне предсказуемый, но неопределенный риск;
 - в) непредсказуемый риск.
3. Если у первого проекта среднее математическое ожидание прибыли больше, чем у второго, а дисперсия у второго больше, значит:
 - а) первый проект лучше;
 - б) второй проект лучше;
 - в) не определено, что лучше.
4. Правильно ли утверждение: «Величина дисперсии определяет рискованность проекта»
 - а) да;
 - б) нет.
5. Выбор варианта решения, при котором разрыв между вероятностями выигрыша и проигрыша для одного и того же рискованного вложения капитала является незначительным, называется:
 - а) правилом оптимальной вероятности результата;
 - б) правилом оптимальной колеблемости результата;
 - в) правилом оптимального сочетания выигрыша и величины риска.

6. Коэффициент вариации – это...

- а) отношение максимально возможного объема убытка по планируемому мероприятию к объему собственных финансовых ресурсов инвестора;
- б) отношение среднего квадратического отклонения к среднему ожидаемому значению;
- в) отношение среднего ожидаемого значения к среднему квадратическому отклонению;
- г) произведение вероятности наступления рискованного события на среднее ожидаемое значение

7. К методам воздействия на риск, которые являются по своей сути финансовыми механизмами и не влияют на частоту возникновения неблагоприятных событий, относятся:

- а) сохранение риска;
- б) снижение риска;
- в) передача риска;
- г) переуступка риска.

8. Учитывая правило оптимальной колеблемости результата наиболее предпочтительным является следующий вариант проекта...

- а) вариант 1: доход 2 млн. руб. с вероятностью 0,6; убыток 1,7 млн. руб. с вероятностью 0,4;
- б) вариант 2: доход 3,5 млн. руб. с вероятностью 0,8; убыток 2,5 млн. руб. с вероятностью 0,2

9. Рыночный риск относится к:

- а) внешним непредсказуемым рискам;
- б) внешним предсказуемым рискам;
- в) внутренним нетехническим рискам;
- г) страхуемым рискам.

10. При оценке степени риска используют показатель колеблемости возможного результата, который определяют с помощью двух критериев:

- а) дисперсии и коэффициента вариации;
- б) дисперсии и среднеквадратического отклонения;
- в) среднеквадратического отклонения и коэффициента риска.

11. Целью анализа риска является:

- а) выявление и оценка риска;
- б) выявление риска и воздействие на риск;
- в) оценка и риска и его снижение.

12. Метод получения финансовых гарантий относится к следующей группе методов воздействия на риск:

- а) снижение риска;
- б) передача риска;

в) сохранение риска

г) исключение риска

Перечень вопросов для проведения промежуточной аттестации

Вопросы к модулю "Управленческие решения"

6. Управленческие решения: понятие, роль и место в управлении
7. Сущность, понятие и типология управленческих решений
8. Классификация видов управленческих решений
9. Основные концепции, принципы и парадигмы управленческих решений
10. Требования, предъявляемые к управленческим решениям
11. Управленческие проблемы и этапы принятия управленческого решения
12. Прогнозирование управленческих решений
13. Основные подходы к принятию управленческих решений
14. Процесс принятия управленческих решений
15. Системный подход в принятии управленческих решений.
16. Модели процесса принятия решений в организациях
17. Методологические основы формирования решений
18. Стандартный процесс принятия решения
19. Информационное обеспечение управленческих решений
20. Диагностика проблемы и постановка целей
21. Разработка и анализ альтернатив действий
22. Методы выбора лучшего решения
23. Понятие эффективности управленческих решений.
24. Методы оценки эффективности управленческих решений.
25. Разработка и реализация управленческих решений на предприятии

Вопросы к модулю "Риск-менеджмент"

26. Неопределенность и риск. Риск как экономическая категория.
27. Сущность, содержание и виды рисков.
28. Классификация рисков по различным критериям.
29. Организация управления риском на предприятии.
30. Схема процесса управления риском.

31. Стратегия и тактика риск-менеджмента.
32. Методы выявления риска.
33. Методы анализа риска и неопределенности.
34. Экспертная оценка риска.
35. Статистическая оценка риска.
36. Оценка риска по прямым капитальным вложениям
37. Оценка риска по рекомендациям ЮНИДО
38. Оценка риска по рекомендациям Минэкономки РФ
39. Оценка риска финансовых активов. Анализ вероятностного распределения доходности
40. Оценка риска финансовых активов. Анализ чувствительности конъюнктуры
41. Виды риска портфеля финансовых инвестиций
42. Модель CARM (увязки систематического риска и доходности ценных бумаг)
43. Методы управления риском
44. Способы снижения степени риска.
45. Правила принятия решений в условиях риска.
46. Методы финансирования риска
47. Определение размера ущерба (убытка), причиненного нарушениями хозяйственных договоров.
48. Определение риска кредитной окупаемости товарных запасов
49. Страхование как один из приемов риск-менеджмента.
50. Сущность и содержание страхования.
51. Функции страхования.
52. Отрасли страхования: личное, имущественное, страхование ответственности.
53. Перестрахование
54. Организационная структура страхования.
55. Оценка эффективности методов управления риском
56. Промышленная безопасность и стратегия управления промышленными рисками
57. Расчет тарифных ставок по рисковым видам страхования
58. Актуарные расчеты в страховании
59. Страхование кредитов