**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**

**РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ   
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«ДОНСКОЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**(ДГТУ)**

Кафедра «Экономическая безопасность, учет и право»

МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ

ДЛЯ ВЫПОЛНЕНИЯ КОНТРОЛЬНОЙ РАБОТЫ

по дисциплине

**«ОЦЕНКА И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ»**

Ростов-на-Дону

2024

УДК 334

ББК 65

Составители: Т.В. Сидорина

«Оценка и управление рисками»: метод. указания для выполнения контрольной работы. – Ростов-на-Дону: Донской гос. техн. ун-т, 2024. – 9 с.

Излагаются задания для выполнения контрольной работы обучающимися по дисциплине «Оценка и управление рисками».

Предназначены для обучающихся по специальности 38.05.01 «Экономическая безопасность», специализация «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности» заочной формы обучения.

УДК 334

ББК 65

Печатается по решению редакционно-издательского совета   
Донского государственного технического университета

Научный редактор д-р экон. наук, профессор Г.Е. Крохичева

Ответственный за выпуск зав. кафедрой «Экономическая безопасность,   
учет и право» д-р экон. наук, профессор Г.Е. Крохичева

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

В печать \_\_\_.\_\_\_.2024 г.

Формат 60×84/16. Объем усл.п.л.

Тираж \_\_\_ экз. Заказ № \_\_\_.

\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

Издательский центр ДГТУ

Адрес университета и полиграфического предприятия:

344000, г. Ростов-на-Дону, пл. Гагарина, 1

© Донской государственный  
технический университет, 2024

**Общие положения**

Для студентов заочной формы обучения учебным планом предусмотрено выполнение контрольной работы.

Контрольная работа по дисциплине «Оценка и управление рисками» выполняется в форме эссе.

Выбор вопроса контрольной работы осуществляется обучающимися согласно порядкового номера в экзаменационной ведомости.

Контрольная работа – это один из основных видов самостоятельной работы обучающихся и важный этап их профессиональной подготовки. Основными целями написания контрольной работы являются: расширение и углубление знаний обучающихся, выработка приемов и навыков в анализе теоретического и практического материала, а также обучение логично, правильно, ясно, последовательно и кратко излагать свои мысли в письменном виде. Обучающийся, со своей стороны, при выполнении контрольной работы должен показать умение работать с литературой, давать анализ соответствующих источников, аргументировать сделанные в работе выводы и, главное, – раскрыть выбранную тему.

При подготовки контрольной работы студенту необходимо обратить внимание на:

1. степень раскрытия сущности проблемы (соответствие содержания теме эссе; полнота и глубина раскрытия основных понятий проблемы; умение работать с литературой, систематизировать и структурировать материал; умение обобщать, сопоставлять различные точки зрения по рассматриваемому вопросу, аргументировать основные положения и выводы, обобщающие авторскую позицию по поставленной проблеме);
2. соблюдение требований по оформлению (правильное оформление текста эссе, ссылок на используемые литературные источники; соблюдение требований к объему эссе; грамотность и культура изложения);

При оформлении контрольной работы обучающимся необходимо руководствоваться документами утвержденными приказом ректора № 242 от 16.12.2020г.:

1. «Правила оформления письменных работ обучающихся для гуманитарных направлений подготовки».

2. «Правила применения шаблонов письменных работ обучающихся».

Форма титульного листа для контрольной работы приведена в приложении А.

По контрольной работе проводится устный опрос (зачет контрольной работы).

По результатам устного опроса по контрольной работе обучающемуся выставляется оценка «зачтено», или «не зачтено».

Оценка «зачтено» выставляется обучающемуся, если:

- обучающийся демонстрирует базовые знания, умения и навыки, примененные при выполнении контрольной работы;

- у обучающегося не имеется затруднений в использовании научно-понятийного аппарата в терминологии курса, а если затруднения имеются, то они незначительные;

- на дополнительные вопросы преподавателя обучающийся дал правильные или частично правильные ответы;

- методические рекомендации при подготовки контрольной работы выполнены в полном объеме.

Компетенция(-и) или ее (их) часть(-и) сформированы на базовом уровне.

Оценка «не зачтено» ставится обучающемуся, если:

- обучающийся имеет представление о содержании темы, но не знает основные положения (темы, раздела, закона и т.д.), к которому относится задание, не способен выполнить задание с очевидным решением, не владеет навыками в области изучаемой дисциплины;

- обучающийся не демонстрирует базовые знания, умения и навыки, необходимые для выполнения заданий контрольной работы;

- в процессе ответа по теоретическому и практическому материалу, содержащиеся в контрольной работе, допущены принципиальные ошибки при изложении материала;

- методические рекомендации при подготовки контрольной работы не выполнены в полном объеме.

Компетенция(-и) или ее (их) часть(-и) не сформированы.

**Темы эссе для выполнения контрольной работы:**

1. Риск в экономической и предпринимательской деятельности.

2. Анализ и оценка рисков организации.

3. Методы оценки рисков.

4. Предпринимательские риски: сущность, понятие, методы оценки и управления.

5. Финансовые риски: сущность, понятие, методы оценки и управления.

6. Кредитные риски: сущность, понятие, методы оценки и управления.

7. Валютные риски. Мировой валютный рынок: современное состояние и перспективы развития. Мировая долларизация и ее место в глобализации.

8. Процентные риски. Влияние учетной ставки процента на экономическую активность. Процентные риски в системе банковских рисков.

9. Операционные риски: идентификация и оценка. Выбор критерия управления операционными рисками.

10. Рыночные риски. Методы оценки и инструменты регулирования.

11. Риски ликвидности. Пути повышения ликвидности и платежеспособности организации.

12. Риски развития. Лидерство в снижении издержек и дифференциация. Поиск наиболее эффективного пути развития.

13. Инвестиционные риски. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта.

14. Инвестиционные риски. Формирование инвестиционного портфеля с учетом риска.

15. Стратегические риски организации.

16. Принятие решений в условиях неопределенности и риска.

17. Методы управления риском.

18. Анализ рисков при угрозе банкротства.

19. Комплаенс риски.

20. Риски в бухгалтерском учете.

21. Налоговые риски.

22. Информационные риски.

**Экзаменационные вопросы по дисциплине**

1. Понятие риска и эволюция представлений о нем.
2. Сущность риска, его структурные характеристики
3. Функции риска
4. Структурные характеристики риска и их содержание
5. Общая классификация рисков
6. Специфические классификации рисков
7. Понятие, цель и задачи риск-менеджмента
8. Функциональная структура риск-менеджмента
9. Организационная структура риск-менеджмента
10. Подходы к управлению рисками и их содержание
11. Функции риск-менеджмента
12. Общая характеристика системы управления рисками
13. Концепция приемлемого риска
14. Активное и пассивное управление рисками
15. Основные этапы управления рисками
16. Качественный анализ (оценка) рисков
17. Картографирование рисков
18. Контент-анализ. Статистические методы оценки рисков
19. Концепция рисковой стоимости ValueatRisk (VaR)
20. Экспертные методы оценки рисков
21. Анализ инвестиционных рисков
22. Классификация методов управления рисками
23. Методы трансформации рисков
24. Методы финансирования рисков
25. Экономическая сущность и классификация финансовых рисков предприятия
26. Сущность и задачи управления финансовыми рисками
27. Методический инструментарий учета фактора риска в финансовых операциях
28. Методы обоснования управленческих решений в условиях риска и неопределенности
29. Механизмы нейтрализации финансовых рисков
30. Стратегия и тактика риск-менеджмента
31. Метод отказа от риска
32. Метод снижения частоты ущерба или предотвращения убытка
33. Метод уменьшения размера убытков
34. Метод разделения риска
35. Метод аутсорсинга риска
36. Стресс-тестирование как метод анализа и оценки рисков
37. Виды стресс-тестов
38. Агрегированное стресс-тестирование
39. Механизм управления рисками, связанными со страховой деятельностью
40. Секьюритизация активов как инструмент управления рисками

**Рекомендуемая литература:**

1. Каранина, Е.В.Риск-менеджмент: учебник: Москва|Берлин: Директ- Медиа, 2020.
2. Фомичев А.Н. Риск-менеджмент: Учебник: Москва: Издательско- торговая корпорация "Дашков и К", 2020.
3. Уколов, А.И.Оценка рисков: учебник: Москва|Берлин: Директ- Медиа, 2021.
4. Ряховская А.Н., Крюкова О.Г.Риск-менеджмент - основа устойчивости бизнеса: Учебное пособие:Москва: Издательство "Магистр", 2019.
5. Рыхтикова Н.А. Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие. Москва: ООО "Научно- издательский центр ИНФРА-М", 2021.
6. Балдин, К.В., Передеряев, И.И. Управление рисками в инновационно- инвестиционной деятельности предприятия: учебное пособие. Москва: Дашков и К°, 2021.
7. Электронно-библиотечная система «IPRbooks».
8. Электронно-библиотечная система «biblioclub».
9. "Университетская библиотека online".
10. Электронно-библиотечная система «znanium».
11. Научно-техническая библиотека ДГТУ.

**ПРИЛОЖЕНИЕ А**

**Форма титульного листа для контрольной работы**



МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ**

**ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**

**«ДОНСКОЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**(ДГТУ)**

Факультет «Инновационный бизнес и менеджмент»

Кафедра «Экономическая безопасность, учет и право»

**КОНТРОЛЬНАЯ РАБОТА**

Дисциплина Оценка и управление рисками

Специальность 38.05.01 «Экономическая безопасность»

Специализация «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности»

Номер зачетной книжки ХХХХХ Номер варианта ХХ Группа ИЗЭБ21

Обучающийся \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ Н.П. Петрова

подпись, дата

Контрольную работу проверил \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ доцент И.И. Иванова

подпись, дата

Ростов-на-Дону

202Х