**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 РИСКОВ»**

Ростов-на-Дону

2022

УДК 33

Составитель: Т.В. Сидорина

Методические указания для выполнения контрольной работы по дисциплине «Оценка рисков». – Ростов-на-Дону : Донской гос. техн. ун-т, 2022. – 8 с.

Содержат контрольные вопросы и задания к контрольной работе.

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

УДК 33

Печатается по решению редакционно-издательского совета   
Донского государственного технического университета

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

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

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

В печать \_\_\_.\_\_\_.20\_\_\_ 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, 2022

**Общие положения**

Выполнение контрольной работы по указанной дисциплине предусмотрено учебным планом и рабочей программой по дисциплине «Оценка рисков».

Контрольная работа представляет собой письменную работу, выполняемую по дисциплине, в рамках которой решаются конкретные задачи либо раскрываются определенные условием вопросы с целью оценки качества усвоения студентами отдельных, наиболее важных разделов, тем и проблем изучаемой дисциплины, умения решать конкретные теоретические и практические задачи.

Выполнение письменных заданий, в виде контрольной работы, один из основных видов самостоятельной работы обучающихся и важный этап их профессиональной подготовки.

Основными целями написания контрольной работы является 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.

Контрольная работа предполагает реферативное изложение двух теоретических вопросов, **выбор которых осуществляется обучающимися согласно порядкового номера в экзаменационной ведомости.**

Преподавателем обеспечивается консультирование обучающихся по данной теме.

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.

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);

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.

**Контрольные вопросы по дисциплине**

1. Цели, задачи и принципы анализа и оценки рисков.

2. Критерии Б. Берлимера.

3. Количественный и качественный анализ риска.

4. Классифицирование угроз и возможностей возникновения рисков.

5. Формы и методы анализа, прогнозирования и оценки рисков, применяемые в зарубежной практике.

6. Анализ чувствительности критериев эффективности (чистый дисконтированный доход (NPV), внутренняя норма доходности (IRR) и др.).

7. Метод сценариев.

8. Методы имитационного моделирования (Монте-Карло) и др.

9. Анализ вероятностных распределений потоков платежей.

10. Построение деревьев решений.

11. Построение детерминированных и стохастических аналитических моделей риска.

12. Методы теории нечетких множеств и нечетких интервалов.

13. Метод корректировки нормы дисконта (премии за риск).

14. Метод достоверных эквивалентов (коэффициентов достоверности).

15. Аналитические и численные методы Value at risk – VAR, используемые для оценки возможных потерь, рыночной стоимости портфеля ценных бумаг.

16. Основы системы SPAN и Eurex.

17. Основы системы SPAN: основные принципы и особенности.

18. Система рискового маржирования биржи Eurex.

19. Концепция рисковой стоимости. Достоинства и недостатки VAR

20. Вероятностное распределение ключевых факторов риска.

21. Методы VAR: линейный, квадратичный.

22. Численные методы расчета.

23. Теоретические основы методов и моделей оценки рисков в деятельности хозяйствующих субъектов.

24. Хозяйственные риски. Внешние и внутренние факторы, влияющие на величину хозяйственных рисков.

25. Функции хозяйственного риска.

26. Методы и модели анализа рисков.

27. Статистический метод.

28. Метод аналогий и др.

29. Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности.

30. Принятие оптимальных решений в условиях неопределенности.

31. Основные понятия теории игр. Предмет теории игр. Понятие игр с природой.

32. Методы решения многокритериальных задач.

33. Сравнительная оценка вариантов решения в зависимости от критериев эффективности.

34. Оптимальность по Паретто.

35. Определение оптимального объема производства.

36. Критерии оптимальности в условиях полной неопределенности

37. Критерий Гурвица.

38. Критерий Сэвиджа.

39. Критерий Вальда.

40. Критерий среднего выигрыша.

41. Критерий Лапласа.

42. Критерий максимакса.

43. Современные методы оценки и управления рисками.

44. Основные тенденции и направления управления рисками.

45. Основные задачи.

46. Управление рисками по типам рисков.

47. Управление рыночными, кредитными, операционными, рисками рыночной ликвидности и др.

48. Систематизация методов количественного анализа, используемых в риск-менеджменте.

**Список рекомендованной литературы**

1. Барбаумов, В.Е. Энциклопедия финансового риск-менеджмента.Москва: Альпина Бизнес Букс, 2020
2. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. -2-е изд., перераб. и доп. - М. : Издательство Юрайт, 2019. - 365 с.
3. Деревяшкин, С.А. Оценка рисков: курс лекций (лекция) Йошкар-Ола: ПГТУ, 2019
4. Жуковский, В. И. Оценка рисков и многошаговые позиционные конфликты : учеб. пособие для вузов / В. И. Жуковский, М. Е. Салуквадзе. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Издательство Юрайт, 2019. -305 с.
5. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для СПО / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Издательство Юрайт, 2019. -381 с
6. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для академического бакалавриата / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Издательство Юрайт, 2019. - 381 с.
7. Каранина, Е.В. Риск-менеджмент: учебник Москва|Берлин: Директ- Медиа, 2020.
8. Киселев, А.А. Риск-менеджмент в управлении организациями: учебник для бакалавриата: учебник Москва|Берлин: Директ- Медиа, 2020.
9. Основы риск-менеджмента / Д. Гэлаи, М. Кроуи, В. Б. Минасян, Р. Марк. - М. : Издательство Юрайт, 2019. - 390 с.
10. Пименов, Н. А. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. А. Пименов. - 2-е изд., перераб. и доп. -М. : Издательство Юрайт, 2019. - 326 с.
11. Ряховская А.Н., Крюкова О.Г.Риск-менеджмент – основа устойчивости бизнеса: Учебное пособие Москва: Издательство "Магистр", 2018.
12. Турчаева И.Н. Оценка рисков: практикум: Практикум Москва: ООО "Научно- издательский центр ИНФРА-М", 2019.
13. Уколов, А.И.Оценка рисков: учебник Москва: Директ-Медиа, 2018.
14. Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент: учебник Москва: Дашков и К°, 2020.
15. Электронно-библиотечная система «IPRbooks», http://www.iprbookshop.ru
16. Электронно-библиотечная система «biblioclub»,
17. "Университетская библиотека online", http://biblioclub.ru
18. Электронно-библиотечная система «znanium», http://www.znanium.com
19. Научно-техническая библиотека ДГТУ, https://ntb.donstu.ru



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 рисков

Специальность 38.05.01 «Экономическая безопасность»

Специализация «Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности»

Номер зачетной книжки Номер варианта Группа ИЗЭБ21

Обучающийся \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

подпись, дата И.П. Петров

Контрольную работу проверил \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

подпись, дата доцент, М.С. Иванов

Ростов-на-Дону

2022