

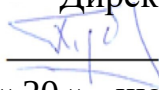
**Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»
(Финуниверситет)**

Владикавказский филиал Финуниверситета

Кафедра «Корпоративные инфокоммуникационные системы»

УТВЕРЖДАЮ

Директор филиала

 Т.А. Хубаев
« 30 » июня 2023 г.

М.А. Ковалева

Информационные технологии управления рисками

Оценочные материалы для проведения текущего контроля успеваемости и
промежуточной аттестации студентов,
обучающихся по направлению подготовки
38.03.05 «Бизнес-информатика»,
образовательная программа «Цифровая трансформация
управления бизнесом»,
профиль «ИТ менеджмент в бизнесе»

*Одобрено заседанием кафедры «Корпоративные
инфокоммуникационные системы»
(протокол от «22» июня 2023 г. № 12)*

Владикавказ 2023

Содержание

1. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине	3
2. Показатели и критерии оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания	4
3. Оценочный лист результатов обучения к дисциплине	5
4. Контрольные материалы, необходимые для оценки индикаторов достижения компетенций, умений и знаний	6

1. Перечень планируемых результатов освоения образовательной программы (перечень компетенций) с указанием индикаторов их достижения и планируемых результатов обучения по дисциплине

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенции	Результаты обучения (умения и знания) соотнесенные с индикаторами достижения компетенции
ПКП-4	Способность разрабатывать предложения для заказчиков по вопросам использования ИТ для трансформации бизнеса	1. Предлагает вариант изменения бизнес-модели предприятия/организации в условиях трансформации бизнеса.	1. Знать: типовые методики и современные компьютерные программы оценки рисков Уметь: применять теоретические знания методик и современных компьютерных программ для оценки финансовых и нефинансовых рисков
		2. Консультирует заказчиков по выбору направления изменений ИТ-ландшафта предприятия/организации с учетом целей трансформации бизнеса.	2. Знать: методы проведения системного анализа и выявления потенциальных рисков на макро-, мезо- и микроуровнях; инструменты снижения рисков, ухода от рисков, минимизации рисков, передачи рисков, принятия рисков при планировании проекта Уметь: реализовывать мероприятия по управлению изменениями в проекте, реализовывать мероприятия по обеспечению ресурсами, распределять информацию, готовить отчеты по мониторингу и управлению сроками, стоимостью, качеством и рисками проекта
ПКН-7	Способность управлять проектами и программами в области ИТ	1. Демонстрирует знания российских и западных стандартов и сводов знаний в области управления проектами.	1. Знать: основные результаты новых исследований, опубликованные в ведущих профессиональных журналах по проблемам управления информационной безопасностью Уметь: применять инструменты, технические средства и информационные технологии результатов решения поставленных профессиональных задач при управлении финансовыми и нефинансовыми рисками
		2. Применяет стандарты и своды знаний для управления проектами.	2 Знать варианты технологического слоя архитектуры предприятия Уметь: организовывать варианты технологического слоя архитектуры предприятия

2. Показатели и критерии оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Уровень сформированности компетенций			
«Минимальный уровень не достигнут» Компетенции не сформированы. Знания отсутствуют, умения и навыки не сформированы.	«Минимальный уровень» Компетенции сформированы. Сформированы базовые структуры знаний. Умения фрагментарны и носят репродуктивный характер. Демонстрируется низкий уровень самостоятельности практического навыка.	«Средний уровень» Компетенции сформированы. Знания обширные, системные. Умения носят репродуктивный характер, применяются к решению типовых заданий. Демонстрируется достаточный уровень самостоятельности устойчивого практического навыка.	«Высокий уровень» Компетенции сформированы. Знания твердые, аргументированные, всесторонние. Умения успешно применяются к решению как типовых, так и нестандартных творческих заданий. Демонстрируется высокий уровень самостоятельности, высокая адаптивность практического навыка
Описание критериев оценивания			
Обучающийся демонстрирует: - существенные пробелы в знаниях учебного материала; - допускаются принципиальные ошибки при ответе на основные вопросы билета, отсутствует знание и понимание основных понятий и категорий; - непонимание сущности дополнительных вопросов в рамках заданий билета; - отсутствие умения выполнять практическое задание, предусмотренные программой дисциплины; - отсутствие	Обучающийся демонстрирует: - знания теоретического материала; - неполные ответы на основные вопросы, ошибки в ответе, недостаточное понимание сущности излагаемых вопросов; - неуверенные и неточные ответы на дополнительные вопросы; - недостаточное владение литературой, рекомендованной программой дисциплины; - умение без грубых ошибок решать	Обучающийся демонстрирует: - знание и понимание основных вопросов контролируемого объема программного материала; - твердые знания теоретического материала. - способность устанавливать и объяснять связь практики и теории, выявлять противоречия, проблемы и тенденции развития; - правильные и конкретные, без грубых ошибок, ответы на	Обучающийся демонстрирует: - глубокие, всесторонние и аргументированные знания программного материала; - полное понимание сущности и взаимосвязи рассматриваемых процессов и явлений, точное знание основных понятий в рамках обсуждаемых заданий; - способность устанавливать и объяснять связь практики и теории; - логически последовательные, содержательные,

готовности (способности) к дискуссии и низкую степень контактности.	практические задания, которые следует выполнить.	поставленные вопросы; - умение решать практические задания, которые следует выполнить; - владение основной литературой, рекомендованной программой дисциплины; - наличие собственной обоснованной позиции по обсуждаемым вопросам. Возможны незначительные оговорки и неточности в раскрытии отдельных положений вопросов билета, присутствует неуверенность в ответах на	конкретные и исчерпывающие ответы на все задания билета, а также дополнительные вопросы экзаменатора; - умение решать практические задания; - свободное использование в ответах на вопросы материалов рекомендованной основной и дополнительной литературы.
Оценка «неудовлетворительно»	Оценка «удовлетворительно» / «зачтено»	Оценка «хорошо» / «зачтено»	Оценка «отлично» / «зачтено»

3. Оценочный лист результатов обучения к дисциплине

Примерные виды работ обучающегося, формирующие текущий контроль по дисциплине

№ п/п	Вид учебной деятельности	Баллы	Максимум за семестр (модуль)
1.	Ведение конспекта лекции / семинара и работа с ним	0,4	2
2.	Активное вовлечение в интерактивный процесс	0,6	3
3.	Ответы на вопросы на семинарском занятии	2	11
4.	Решение задач с последующим обсуждением их результатов	0,6	6
5.	Собеседование по материалу и обсуждение результатов	0,8	7
6.	Выполнение домашней контрольной (расчетно-аналитической) работы	-	10
7.	Посещение аудиторных занятий	0,2	1
	Всего за семестр (модуль)		40

Критерии балльной оценки включают качество подготовки обучающихся к семинарским занятиям, выполнения различных видов самостоятельной работы (при этом результаты регулярно проводимого экспресс-контроля успеваемости обучающихся должны составлять не менее 50% балльной оценки), а также посещение аудиторных занятий (не более 15% балльной оценки).

При подведении итогов текущего контроля успеваемости в середине семестра его результаты в 20-балльной оценке вносятся в ведомости текущего контроля успеваемости и использованием ТЭКУ (в филиалах – в ведомости текущего контроля успеваемости) и на соответствующей странице предметно-группового журнала преподавателям, ведущим аудиторные занятия.

Обучающийся, получивший от 7 до 20 баллов, считается аттестованным, получивший от 0 до 6 баллов – не аттестованным.

Результаты текущего контроля успеваемости за вторую половину семестра / в модуле преподаватели, ведущие аудиторные занятия, сообщают обучающимся на последнем занятии и вносят в ведомости (в колонку «баллы, работа в семестре») в день проведения зачета/экзамена.

Итоговая сумма баллов, полученная обучающимся по результатам текущего контроля успеваемости в семестре/модуле и промежуточной аттестации, преобразуется в пятибалльную систему оценок.

Порядок перевода 100-балльной оценки в пятибалльную

100-балльная система	5-балльная система
86-100	отлично
70-85	хорошо
50-69	удовлетворительно
менее 50	неудовлетворительно
50-100	зачтено
менее 50	не зачтено

4. Контрольные материалы, необходимые для оценки индикаторов достижения компетенций, умений и знаний

Текущий контроль

Тема 1. Понятие и классификация рисков

Вопросы для проведения опроса ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

1. Понятие неопределенности, риска и рисков ситуации. Причины, источники и признаки возникновения риска, факторы проявления рисков.

2. Вероятность риска, степень риска, уровень риска, размер потерь, приемлемость риска. Негативные и позитивные последствия воздействия рисков.

3. Термины и правила: определенность, неопределенность, достоверность, невероятность, катастрофа, риск. Приведите примеры на каждое определение.

4. Расчет размера фонда компенсации. Центральная предельная теорема.

5. Понятие риска. Определение риска. Факторы, имеющие случайную природу и определяющие риск.

6. Сбалансированность риска. Законы распределений. Среднеквадратическое отклонение, коэффициент вариации как степень и мера риска.

Контрольные вопросы по теме семинарского занятия ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

1. Понятие неопределенности, риска и рискованной ситуации.

2. Причины, источники и признаки возникновения риска, факторы проявления рисков.

3. Источники риска, классы риска

4. Идентификация (установление) всех возможных рисков; выявление источников и причин риска; выявление практических выгод и возможностей негативных последствий, которые могут наступить при реализации содержащего риск решения.

Практико-ориентированная задача 1. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

Анализ ситуации: идентификация рисков

Описание ситуации

Системный интегратор «Big&Co» был выбран в качестве генерального подрядчика по проекту внедрения информационной системы (ИС) в компании «Client Company». В соответствии с договором работы проводились в три этапа:

- 1) выбор решения и поставка ПО;
- 2) внедрение ИС;
- 3) постпроектное сервисное обслуживание.

Руководителем второго этапа работ был назначен Василий из числа менеджеров проектов «Big&Co». К моменту назначения Василия первый этап был уже завершен: определен класс и вендор внедряемой ИС, ПО поставлено в соответствии со спецификацией. Для выполнения работ второго этапа со стороны «Big&Co» были выделены архитектор ИТ-решения и консультант по внедрению ИС. Вместе с ними Василий разработал план-график предстоящих работ, согласовал его с представителями «Client Company» внутри «Big&Co».

В соответствии с утвержденным планом было произведено проектирование ИС, разработано и согласовано с заказчиком техническое задание, после чего консультант по внедрению приступил к работе по настройке системы. По согласованному плану внедрение предполагалось вести поэтапно, при этом часть работ по подготовке системы к внедрению брал на себя заказчик.

Таким образом, ответственность за различные этапы работ возлагалась попеременно то на специалистов компании. заказчика, то на специалистов компании-исполнителя.

График работ был построен так, что зачастую приступить к исполнению очередной операции было невозможно до завершения предшествующей. Приступив работам, консультант по внедрению «Big&Co» обнаружил и сразу проинформировал Василия, что специалисты «Client Company» не могут уделять проектным работам достаточно времени, ссылаясь на недоукомплектованность штата, повышенную загрузку операционными задачами и низкий приоритет проекта.

Выполнение проектных работ стало затягиваться, возникла опасность срыва сроков, отношение сотрудников «Client Company» к проекту ухудшилось. Василий переговорил с представителем компании-заказчика и

получил заверения, что меры будут приняты. Вскоре выяснилось, что ситуация не изменилась. Василий повторно проинформировал «Client Company» и снова получил от вет, что проблема будет решена в кратчайшие сроки. Консультант по внедрению тем временем докладывал, что на объектах он часть времени бездействует, ожидая, пока технические специалисты «Client Company» освободятся и смогут выполнить свою долю работ, предусмотренную согласованным планом.

Без их участия выполнить настройки ИС было невозможно, так как консультант «Big&Co», в соответствии с положениями политики по информационной безопасности Client Company, не имел прав доступа к модулю настройки внедряемой ИС. Предложение о предоставлении этих полномочий было не раз отвергнуто представителями «Client Company». В этих условиях Василий принял решение об эскалации проблемы на уровень старшего менеджера из отдела продаж - Петра. Доложив Петру о ситуации, он предложил собрать рабочее совещание с привлечением высшего руководства «Client Company», чтобы найти выход. Петр высказал сомнение в пользе такого совещания и предоставил Василию карт-бланш, посоветовав решать проблему самостоятельно. Василий еще раз связался с представителями «Client Company» и предложил определить ключевые вехи, достижение которых позволило бы закрыть второй этап договора, а оставшуюся часть работ провести на этапе сервисного обслуживания.

Компромисс был найден, но: по причине выявленной некорректной работы внедряемой ИС отставание по срокам ликвидировать не удалось, а неприятие проекта сотрудниками «Client Company» усугубилось; ресурсы заметную часть времени использовались неэффективно; вследствие затягивания работ возникли накладки с планированием ресурсов и сбои по срокам в других проектах; в связи с падением выручки «Client Company», вызванным неблагоприятной экономической конъюнктурой, финансирование проекта было урезано.

Постановка задачи (идентификация рисков):

1. На основе приведенной информации о проекте и, при необходимости, дополнительных допущений идентифицируйте и классифицируйте риски (6-8 шт.) данного проекта.

2. Используя предложенный шаблон (табл. 1), разработайте подход к управлению идентифицированными в предыдущем пункте рисками.

Таблица 1 - Шаблон для идентификации рисков IT-проектов

Риск	Последствия риска	Стратегия реагирования на риск	Проактивные действия	Реактивные действия	Факты, демонстрирующие релевантность риска для данной бизнес ситуации

Практико-ориентированная задача 2. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

Вам поступили две кредитные заявки: одна традиционная, другая рискованная, но и доходы по рискованной заявке очень высоки. Вы ограничены в ресурсах и не можете удовлетворить обе заявки сразу. Какой вариант решения, по Вашему мнению, следует принять и приведите обоснование своего решения?

Тема 2. Диагностика, анализ и оценка рисков. Управление рисками

Вопросы для проведения опроса ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

1. Виды рисков.
2. Минимизация ущерба, снижение риска.
3. Анализ риска.
4. Цель управление риском. Первый этап управления риска — идентификация.
5. Тривиальный расчет премии за риск в схеме перераспределения. Индивидуальный риск с полным разрушением объекта.
6. Термины и правила расчета сбалансированности риска: фонд компенсации убытков, гарантия, размер фонда компенсации. Приведите

примеры на каждое определение.

7. Оценка (цель, механизмы) и управление (механизмы) риском.

Контрольные вопросы (вопросы блиц-опроса) по теме семинарского занятия ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

1. Виды рисков. Минимизация ущерба, снижение риска.

2. Вероятность риска, степень риска, уровень риска, размер потерь, приемлемость риска. Негативные и позитивные последствия воздействия рисков.

4. Анализ риска: выявление, оценка; выбор методов воздействия на риск; Принятие решения; Воздействие на риск: снижение, сохранение, передача; Контроль результатов и корректировка решений.

Практико-ориентированная задача 1. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

Выдавая гарантию своему клиенту, банк принимает риски своего клиента. В чём смысл такой операции для банка? В каких случаях банк-гарант обязан заплатить за клиента? Как банк оценивает риски гарантийных операций? Как ЦБ РФ ограничивает риски гарантийных операций коммерческих банков?

Практико-ориентированная задача 2. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

В условиях кризиса возрастают как систематические, так и спекулятивные риски банковской деятельности. Какие риски с точки зрения Банка России наиболее серьезные? Какие риски серьезными считает банковское сообщество? Как, согласно методики Банка России, проводится оценка совокупного уровня риска, взятого банками на себя?

Тема 3. Информационные технологии управления рисками

Вопросы для проведения опроса ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

1. Понятие ERM–системы.

2. Основные ERM-системы

3. Термины и правила расчета сбалансированности риска: совокупность рисков, однородность, актуарно-однородная совокупность. Приведите примеры на каждое определение.

4. Тривиальный расчет премии за риск в схеме перераспределения. Совокупность из двух групп рисков с полным разрушением объекта (правило построение свертки дискретных распределений).

5. Расчет безубыточности фонда. Расчет рисковых премий пропорционально математическому ожиданию.

6. Расчет безубыточности фонда. Расчет рисковых премий пропорционально дисперсии.

Контрольные вопросы по теме семинарского занятия ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

1. Понятие ERM–системы.
2. Основные ERM-системы.
3. Реестр рисков производственной компании.
4. Составление базы произошедших рисковых событий.
5. Актуализация базы рисков.
6. Структура модели и анализ бизнес-рисков. Разработка стратегий.

Практико-ориентированная задача 1. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

Управление рисками – одна из ключевых задач стратегического менеджмента банка. Сформулируйте основные этапы политики управления рисками и предложите способы их минимизации. Например, каким образом банк может минимизировать риск ликвидности (включая все его разновидности)? Какие способы из известных в мировой практике могут применять российские банки?

Практико-ориентированная задача 2. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

Одним из способов управления риском кредитного портфеля является секьюритизация его части. В чём состоит процедура секьюритизации? Какие кредиты российские банки передают для секьюритизации? Какие риски могут возникнуть при использовании секьюритизации?

Тема 4. Методология управления рисками ИТ-проектов

Вопросы для проведения опроса ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

1. Функционирование ИТ технологий управления рисками в российских компаниях.

2. Функционирование ИТ технологий управления рисками в зарубежных ИТ-компаниях.

3. Принципы назначения премий. Разделение добавочной стоимости пропорционально дисперсии выплат по договору. Относительная страховая надбавка.

4. Термины и правила: рисковый период, кратность риска, лимит опасности, индивидуальный риск, коллективный риск. Приведите примеры на каждое определение.

5. Принципы назначения премий. Разделение добавочной стоимости пропорционально дисперсии выплат по договору. Относительная страховая надбавка.

6. Сбалансированность риска. Законы распределений. Среднеквадратическое отклонение, коэффициент вариации как степень и мера риска.

Контрольные вопросы по теме семинарского занятия ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

1. Функционирование ИТ технологий управления рисками в российских компаниях.

2. Функционирование ИТ технологий управления рисками в зарубежных ИТ-компаниях.

3. Сущность риск-анализа инвестиционного проекта. Качественный и количественный анализ рисков инвестиционного проекта. Вероятностная имитационная модель управления риском инвестиционного проекта. Управление риском как ресурсом в ходе формирования инвестиционного портфеля.

Практико-ориентированная задача 1. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

Какие банки в России чаще всего рискуют попасть в кризисные ситуации – молодые или относительно давно действующие? Универсальные

или узко специализированные? Работающие только с юридическими лицами или также с населением? Существует ли конкретная категория банков, наиболее подверженная кризисным явлениям?

Практико-ориентированная задача 2. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

По каким признакам можно судить о том, что в банке возникли и нарастают явления кризисного характера? Какими признаками начала кризисных явлений банк может себе позволить пренебрегать и как долго? К возникновению у банка признаков проблемности его хозяева и менеджеры могут отнестись по-разному. От чего это зависит?

Практико-ориентированная задача 3. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

Российские банки помимо процентных платежей обычно устанавливают для заемщиков различные дополнительные комиссии по ссуде. На примере какого-либо банка составьте список устанавливаемых комиссий и объясните их назначение. Рассчитайте, насколько эти комиссии делают обслуживание кредита дороже.

Практико-ориентированная задача 4. ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)

В текущей деятельности банки могут столкнуться с образованием так называемых «плохих» долгов. Какую задолженность по кредитам Банк России относит к «плохим» долгам. В чем различие между пролонгацией кредита и его реструктуризацией? С какими рисками сталкиваются кредиторы при реструктуризации ссудной задолженности?

Перечень тем для выполнения контрольной работы

1. Постройте классификацию рисков в деятельности производственного предприятия. Разработайте схему взаимного влияния рисков производственного предприятия. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

2 Постройте классификацию рисков в деятельности коммерческого предприятия. Составьте таблицу источников информационного обеспечения управления рисками коммерческого предприятия. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

3 Постройте классификацию рисков в деятельности финансовых учреждений. Разработайте таблицу методов управления рисками в финансовом учреждении, выявите их достоинства и недостатки. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2)).

4 Постройте классификацию рисков в деятельности кредитных организаций. Предложите алгоритм управления рисками в условиях кредитной организации. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

5 Проведите сравнительный анализ статистических и экспертных методов оценки рисков. Сформулируйте правила принятия рискованных решений в коммерческих организациях. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

6 Составьте таблицу сравнительного анализа эффективности управления рисками в коммерческой организации. Предложите критерии отбора рисков, управляемых с помощью страхования и самострахования. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

7. Постройте схему взаимного влияния рисков коммерческой организации. Сформулируйте предложения по созданию системы управления рисками коммерческой организации. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

8 Раскройте содержание и взаимодействие стратегического, тактического и оперативного уровней управления рисками организации. Опишите функциональные обязанности менеджера по рискам. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

9 Представьте схематично взаимодействие структурного подразделения организации по управлению рисками и других структурных подразделений на примере коммерческого банка. Сформулируйте предложения по управлению кредитными рисками коммерческого банка. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

10 Постройте классификацию рисков в деятельности финансовых учреждений. Сформулируйте требования к управлению операционными рисками коммерческого банка. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

11 Опишите этапы создания системы управления рисками производственного предприятия. Предложите критерии оценки эффективности системы управления рисками для производственного предприятия. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

12 Сформулируйте содержание и факторы риска банкротства. Перечислите и дайте краткую характеристику методам оценки риска банкротства. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

13 Сформулируйте содержание и факторы кредитного риска. Перечислите и дайте краткую характеристику методам оценки кредитного риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

14 Сформулируйте содержание и факторы инвестиционного риска. Перечислите и дайте краткую характеристику методам оценки инвестиционного риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

15 Сформулируйте содержание и факторы риска потери платежеспособности. Перечислите и дайте краткую характеристику методам оценки риска потери платежеспособности (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

Промежуточный контроль

Перечень вопросов для подготовки к зачету

1. Техника диагностики рисков. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
2. Классификация методов оценки и анализа рисков. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
3. Понятие ERM-систем. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
4. Основные ERM-системы. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
5. Минимизация ущерба, снижение риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
6. Понятие неопределенности, риска и рисков ситуации (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
7. Негативные и позитивные последствия воздействия рисков. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
8. Функционирование ИТ технологий управления рисками в российских

- компаниях. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
9. Понятие приемлемости риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 10. Анализ риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 11. Методы воздействия на риск. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 12. Эволюция взглядов на категории риск?. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 13. Выбор инвестиционного портфеля в условиях неопределенности и риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 14. Предпосылки и факторы, предшествующие наступлению рискованных ситуаций. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 15. Сущность и содержание риск-менеджмента. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 16. Анализ и оценка уровня риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 17. Методы уклонения от риска и его компенсации. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 18. Методы управления финансовым риском. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 19. Классификация рисков. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 20. Роль Банка России в управлении банковскими рисками. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 21. Способы снижения процентного и кредитного риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 22. Понятие и классификация рисков в страховом бизнесе. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 23. Концепция рисковой стоимости (Value at risk ? VAR). (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 24. Организация управления риском на производственном предприятии. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 25. Метод статистических испытаний (Monte-Carlo simulation). (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 26. Управление кредитным риском в деятельности банков. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
 27. Статистические методы оценки риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))

28. Критерий ожидаемой полезности. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
29. Причины, факторы и симптомы кризисного развития экономики. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
30. Диагностика банкротства предприятий. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
31. Зарубежная практика риск-менеджмента. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
32. Основные стратегии вывода предприятия из кризиса. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
33. Классификация антикризисных стратегий. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
34. Оценка риска и выбор управленческих решений (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
35. Стоимость под риском, VaR. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
36. Проактивная и реактивная гибкость. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
37. Применение ROV (реальные опционы) для управления рисками. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
38. Применение дерева решений для принятия решения с учетом риска. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
39. Реестр рисков компании. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
40. Карта рисков. Примеры составления карт для различных отраслей. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
41. Применение дерева решений для принятия стратегических решений по развитию. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
42. Составление базы произошедших рисковых событий. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
43. Актуализация базы рисков: ежегодная и ежеквартальная. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
44. Процедуры и ответственные лица. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
45. Структура модели и анализ бизнес-рисков. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
46. Актуализация карты рисков: квартальная и месячная. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
47. Роль внутреннего контроля в профилактике рисков. (ПКН-7(1,2), ПКП-

4(1,2))

48. Формирование риск ориентированной внутренней культуры в компании. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
49. Разработка противорисковых мероприятий: формирование резервов. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
50. Разработка противорисковых мероприятий: изменение ментальности сотрудников. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
51. Разработка противорисковых мероприятий: страхование. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
52. Разработка противорисковых мероприятий: хеджирование рисков. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
53. Разработка противорисковых мероприятий: сознательное отсутствие действий(ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
54. Связь риска и требуемой доходности: участие риск менеджмента в построении годовых бюджетов. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
55. Связь риска и требуемой доходности: участие риск менеджмента в построении долгосрочных финансовых моделей. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
56. Стоимость противорисковых мероприятий: оценка окупаемости принимаемых решений. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
57. Меры по предотвращению и обнаружению, Определение приоритетного числа риска и рекомендуемые мероприятия. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
58. Способы противодействия рискам. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
59. Избегание, Программы недопущения рисков. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
60. Мониторинг. Отсутствие действий (сознательное). (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
61. Оценка управляющих последствий противорисковых мероприятий. (ПКН-7(1,2), ПКП-4(1,2))
62. Изменение вероятности наступления события. (ПКН-7(1,2), ПКП-

$4(1,2))$