**МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РФ**

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования**

«ТОМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ СИСТЕМ
УПРАВЛЕНИЯ И РАДИОЭЛЕКТРОНИКИ»
(ТУСУР)

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе
_____ П. Е. Троян
«___» _____ 20__ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

# Риск-менеджмент

Уровень образования: **высшее образование - бакалавриат**
Направление подготовки (специальность): **38.03.02 Менеджмент**
Направленность (профиль): **Финансовый менеджмент**
Форма обучения: **очная**
Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**
Кафедра: **экономики, Кафедра экономики**
Курс: **4**
Семестр: **7**
Учебный план набора 2015 года

Распределение рабочего времени

| № | Виды учебной деятельности | 7 семестр | Всего | Единицы |
|---|---|---|---|---|
| 1 | Лекции | 36 | 36 | часов |
| 2 | Практические занятия | 36 | 36 | часов |
| 3 | Всего аудиторных занятий | 72 | 72 | часов |
| 4 | Самостоятельная работа | 36 | 36 | часов |
| 5 | Всего (без экзамена) | 108 | 108 | часов |
| 6 | Общая трудоемкость | 108 | 108 | часов |
| | | 3.0 | 3.0 | З.Е |

Зачет: 7 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 10815

Рассмотрена и одобрена на заседании кафедры
протокол № 1 от « 9 » 1 2017 г.

ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЙ

Рабочая программа составлена с учетом требований Федерального Государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки (специальности) 38.03.02 Менеджмент, утвержденного 2016-04-20 года, рассмотрена и утверждена на заседании кафедры «___» _____ 20__ года, протокол №_____.

Разработчики:

Доцент каф. Экономики _____ Цибульникова В. Ю.

Заведующий обеспечивающей каф. экономики _____ Рыжкова М. В.

Рабочая программа согласована с факультетом, профилирующей и выпускающей кафедрами направления подготовки (специальности).

Декан ЭФ _____ Богомолова А. В.

Заведующий выпускающей каф. экономики _____ Рыжкова М. В.

Эксперты:

Доцент каф. Экономики _____ Земцова Л. В.

Согласована на портале № 10815

## 1. Цели и задачи дисциплины

### 1.1. Цели дисциплины

Целями освоения дисциплины являются: формирование у студентов устойчивых знаний о методах оценки, анализа и управления рисками, а также умений и навыков использования этих инструментов в процессе управления организацией

### 1.2. Задачи дисциплины

– познакомить с основными элементами системы управления финансовыми рисками организации, приемами управления предпринимательскими и финансовыми рисками предприятия и типовыми методами и моделями, используемых в анализе и оптимизации финансовых операций с учетом факторов риска;

– научить использовать в практической деятельности современные специальные экономико-математические инструментарии анализа и оценки риска;

– научить технологиям выработки решений в условиях риска и неопределенности и решению типовых задач по управлению финансовыми рисками организации.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Риск-менеджмент» (Б1.Б.24) относится к блоку 1 (базовая часть).

Предшествующими дисциплинами, формирующими начальные знания, являются следующие дисциплины: Управление изменениями, Финансовые рынки и институты, Финансовый менеджмент.

Последующими дисциплинами являются: Управление инвестициями, Управление проектами.

## 3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– ПК-15 умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании;

В результате изучения дисциплины студент должен:

– **знать** содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методологию процесса управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками.

– **уметь** применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками; классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления; проводить выбор между способами передачи рисков, осуществлять соответствующие расчеты к ним; оценивать результативность принятых управленческих решений; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач анализа и оценки рисков. использовать математические и статистические методы расчета уровня рисков, определять привлекательность инвестиционного портфеля, пользоваться инструментами риск-менеджмента.

– **владеть** методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения поручений.

## 4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3.0 зачетных единицы и представлена в таблице 4.1.

Таблица 4.1 – Трудоемкость дисциплины

| Виды учебной деятельности | Всего часов | Семестры |
|---|---|---|
| | | 7 семестр |
| Аудиторные занятия (всего) | 72 | 72 |

Согласована на портале № 10815

| | | |
|---|---|---|
| Лекции | 36 | 36 |
| Практические занятия | 36 | 36 |
| Самостоятельная работа (всего) | 36 | 36 |
| Проработка лекционного материала | 10 | 10 |
| Подготовка к практическим занятиям, семинарам | 26 | 26 |
| Всего (без экзамена) | 108 | 108 |
| Общая трудоемкость час | 108 | 108 |
| Зачетные Единицы Трудоемкости | 3.0 | 3.0 |

## 5. Содержание дисциплины

### 5.1. Разделы дисциплины и виды занятий

Разделы дисциплины и виды занятий приведены в таблице 5.1.

Таблица 5.1 – Разделы дисциплины и виды занятий

| № | Названия разделов дисциплины | Лекции | Практические занятия | Самостоятельная работа | Всего часов (без экзамена) | Формируемые компетенции |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | Методологические основы системы управления рисками проектов | 16 | 12 | 16 | 44 | ПК-15 |
| 2 | Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента | 20 | 24 | 20 | 64 | ПК-15 |
| | Итого | 36 | 36 | 36 | 108 | |

### 5.2. Содержание разделов дисциплины (по лекциям)

Содержание разделов дисциплин (по лекциям) приведено в таблице 5.2.

Таблица 5.2 - Содержание разделов дисциплин (по лекциям)

| Названия разделов | Содержание разделов дисциплины по лекциям | Трудоемкость, ч | Формируемые компетенции |
|---|---|---|---|
| 7 семестр | | | |
| 1 Методологические основы системы управления рисками проектов | 1. Понятие и сущность риска. | 2 | ПК-15 |
| | 2. Определение, функции, организация и правила управление рисками. | 2 | |
| | 3. Информационное обеспечение управления рисками. | 4 | |
| | 4. Классификация рисков. | 4 | |
| | 5. Анализ и оценка степени риска | 4 | |
| | Итого | 16 | |

Согласована на портале № 10815

| | | | |
|---|---|---|---|
| 2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента | 6. Управление банковскими рисками. | 4 | ПК-15 |
| | 7. Управление рисками, возникающими при инвестировании. | 2 | |
| | 8. Система Риск-менеджмента в организации. | 2 | |
| | 9. Основы хеджирования рисков. | 4 | |
| | 10. Анализ риска в инвестиционной программе. | 2 | |
| | 11. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. | 2 | |
| | 12. Рациональный выбор инвестиционного портфеля. | 2 | |
| | 13. Методы управления рисками | 2 | |
| | Итого | 20 | |
| Итого за семестр | | 36 | |

**5.3. Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами**

Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами представ-лены в таблице 5.3.

Таблица 5.3 - Разделы дисциплины и междисциплинарные связи

| № | Наименование дисциплин | № разделов данной дисциплины, для которых необходимо изучение обеспечивающих и обеспечиваемых дисциплин | |
|---|---|---|---|
| | | 1 | 2 |
| Предшествующие дисциплины | | | |
| 1 | Управление изменениями | + | |
| 2 | Финансовые рынки и институты | + | |
| 3 | Финансовый менеджмент | | + |
| Последующие дисциплины | | | |
| 1 | Управление инвестициями | | + |
| 2 | Управление проектами | + | |

**5.4. Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий**

Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий представлено в таблице 5.4

Таблица 5. 4 – Соответствие компетенций и видов занятий, формируемых при изучении дисциплины

| | Виды занятий | Формы контроля |
|---|---|---|

Согласована на портале № 10815

| Компетенции | Лекции | Практические занятия | Самостоятельная работа | |
|---|---|---|---|---|
| ПК-15 | + | + | + | Опрос на занятиях, Расчетная работа, Тест |

**6. Интерактивные методы и формы организации обучения**

Не предусмотрено РУП

**7. Лабораторный практикум**

Не предусмотрено РУП

**8. Практические занятия**

Содержание практических работ приведено в таблице 8.1.

Таблица 8. 1 – Содержание практических работ

| Названия разделов | Содержание практических занятий | Трудоемкость, ч | Формируемые компетенции |
|---|---|---|---|
| 7 семестр | | | |
| 1 Методологические основы системы управления рисками проектов | Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности. | 6 | ПК-15 |
| | Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределѐнности и риска минимаксными методами | 6 | |
| | Итого | 12 | |
| 2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента | Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента | 6 | ПК-15 |
| | Комплексная оценка рисков проекта с учетом внешнеэкономических факторов | 6 | |
| | Разработка хеджирующего портфеля для оптимизации рисков организации | 6 | |
| | Оценка рисков инвестирования в финансовые активы, портфельное инвестирование | 6 | |
| | Итого | 24 | |
| Итого за семестр | | 36 | |

**9. Самостоятельная работа**

Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции представлены в

Согласована на портале № 10815

таблице 9.1.

Таблица 9.1 - Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции

| Названия разделов | Виды самостоятельной работы | Трудоемкость ч | Формируемые компетенции | Формы контроля |
|---|---|---|---|---|
| 7 семестр | | | | |
| 1 Методологические основы системы управления рисками проектов | Подготовка к практическим занятиям, семинарам | 12 | ПК-15 | Опрос на занятиях, Расчетная работа, Тест |
| | Проработка лекционного материала | 4 | | |
| | Итого | 16 | | |
| 2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента | Подготовка к практическим занятиям, семинарам | 14 | ПК-15 | Опрос на занятиях, Расчетная работа, Тест |
| | Проработка лекционного материала | 6 | | |
| | Итого | 20 | | |
| Итого за семестр | | 36 | | |
| Итого | | 36 | | |

## 10. Курсовая работа

Не предусмотрено РУП

## 11. Рейтинговая система для оценки успеваемости студентов

### 11.1. Балльные оценки для элементов контроля

Таблица 11.1 – Балльные оценки для элементов контроля

| Элементы учебной деятельности | Максимальный балл на 1-ую КТ с начала семестра | Максимальный балл за период между 1КТ и 2КТ | Максимальный балл за период между 2КТ и на конец семестра | Всего за семестр |
|---|---|---|---|---|
| 7 семестр | | | | |
| Опрос на занятиях | 5 | 10 | 10 | 25 |
| Расчетная работа | 10 | 15 | 20 | 45 |
| Тест | 10 | 10 | 10 | 30 |
| Итого максимум за период | 25 | 35 | 40 | 100 |
| Нарастающим итогом | 25 | 60 | 100 | 100 |

### 11.2. Пересчет баллов в оценки за контрольные точки

Пересчет баллов в оценки за контрольные точки представлен в таблице 11.2.

Таблица 11. 2 – Пересчет баллов в оценки за контрольные точки

| Баллы на дату контрольной точки | Оценка |
|---|---|
| ≥ 90% от максимальной суммы баллов на дату КТ | 5 |
| От 70% до 89% от максимальной суммы баллов на дату КТ | 4 |

Согласована на портале № 10815

| | |
|---|---|
| От 60% до 69% от максимальной суммы баллов на дату КТ | 3 |
| < 60% от максимальной суммы баллов на дату КТ | 2 |

### 11.3. Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку представлен в таблице 11.3.

Таблица 11. 3 – Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

| Оценка (ГОС) | Итоговая сумма баллов, учитывает успешно сданный экзамен | Оценка (ECTS) |
|---|---|---|
| 5 (отлично) (зачтено) | 90 - 100 | A (отлично) |
| 4 (хорошо) (зачтено) | 85 - 89 | B (очень хорошо) |
| | 75 - 84 | C (хорошо) |
| | 70 - 74 | D (удовлетворительно) |
| 3 (удовлетворительно) (зачтено) | 65 - 69 | |
| | 60 - 64 | E (посредственно) |
| 2 (неудовлетворительно) (не зачтено) | Ниже 60 баллов | F (неудовлетворительно) |

## 12. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### 12.1. Основная литература

1. Управление рисками проектов: Учебное пособие / Кулешова Е. . - 2015. 188 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4956, дата обращения: 20.01.2017.

### 12.2. Дополнительная литература

1. Анализ и управление рисками организации : учебное пособие для вузов / Н. А.Рыхтикова. - М. : Форум, 2009. - 239[1] с. : ил., табл. - (Высшее образование). - Библиогр.: с.233-237. - ISBN 978-5-91134-195-4 (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)
2. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций : / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 7-е изд. - М. : Дашков и К°, 2008. - 543[1] с. : ил., портр., табл. - Библиогр.: с. 531-536. - ISBN 978-5-394-00062-1 (наличие в библиотеке ТУСУР - 4 экз.)

### 12.3 Учебно-методические пособия

#### 12.3.1. Обязательные учебно-методические пособия

1. Управление рисками: Методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе для студентов направления 080200.62 – «Менеджмент», профиль – «Управление проектом» / Кулешова Е. В. - 2014. 38 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4889, дата обращения: 20.01.2017.
2. Управление рисками: Методические указания к лабораторным, практическим занятиям и самостоятельной работе для студентов направления 080100.62 – «Экономика», профиль - «Финансы и кредит» / Кулешова Е. В. - 2014. 38 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4890, дата обращения: 20.01.2017.

#### 12.3.2 Учебно-методические пособия для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Учебно-методические материалы для самостоятельной и аудиторной работы обучающихся из числа инвалидов предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации.

**Для лиц с нарушениями зрения:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

**Для лиц с нарушениями слуха:**

Согласована на портале № 10815

– в форме электронного документа;
– в печатной форме.

**Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:**

– в форме электронного документа;
– в печатной форме.

### 12.4. Базы данных, информационно-справочные, поисковые системы и требуемое программное обеспечение

1. Научная электронная библиотека http://elibrary.ru
2. Российская государственная библиотека http://www.rsl.ru
3. Российская национальная библиотека http://www.nlr.ru
4. Электронные книги http://books.mlmbiz.ru
5. Публичная Интернет-библиотека http://www.public.ru
6. Библиотека экономики http://www.finansy.ru/publ.htm

## 13. Материально-техническое обеспечение дисциплины

### 13.1. Общие требования к материально-техническому обеспечению дисциплины

#### 13.1.1. Материально-техническое обеспечение для лекционных занятий

Для проведения занятий лекционного типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации используется учебная аудитория, с количеством посадочных мест не менее 22-24, оборудованная доской и стандартной учебной мебелью. Имеются наглядные пособия в виде презентаций по лекционным разделам дисциплины.

#### 13.1.2. Материально-техническое обеспечение для практических занятий

Для проведения практических (семинарских) занятий используется учебная аудитория, расположенная по адресу 634034, Томская область, г. Томск, Красноармейская улица, д. 146, 4 этаж, ауд. 611. Состав оборудования: Учебная мебель; Доска магнитно-маркерная -1шт.; Коммутатор D-Link Switch 24 port - 1шт.; Компьютеры класса не ниже ПЭВМ INTEL Celeron D336 2.8ГГц. -30 шт. Используется лицензионное программное обеспечение, пакеты версией не ниже: Microsoft Windows XP Professional with SP3/Microsoft Windows 7 Professional with SP1; Microsoft Windows Server 2008 R2; Visual Studio 2008 EE with SP1; Microsoft Office Visio 2010; Microsoft Office Access 2003; VirtualBox 6.2. Имеется помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования.

#### 13.1.3. Материально-техническое обеспечение для самостоятельной работы

Для самостоятельной работы используется учебная аудитория (компьютерный класс), расположенная по адресу 634034, г. Томск, ул. Красноармейская, 146, 2 этаж, ауд. 204. Состав оборудования: учебная мебель; компьютеры класса не ниже ПЭВМ INTEL Ce1егоп D336 2.8ГГц. - 7 шт.; компьютеры подключены к сети ИНТЕРНЕТ и обеспечивают доступ в электронную информационно-образовательную среду университета.

### 13.2. Материально-техническое обеспечение дисциплины для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Освоение дисциплины лицами с ОВЗ осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения.

При обучении студентов **с нарушениями слуха** предусмотрено использование звукоусиливающей аппаратуры, мультимедийных средств и других технических средств приема/передачи учебной информации в доступных формах для студентов с нарушениями слуха, мобильной системы обучения для студентов с инвалидностью, портативной индукционной системы. Учебная аудитория, в которой обучаются студенты с нарушением слуха, оборудована компьютерной техникой, аудиотехникой, видеотехникой, электронной доской, мультимедийной системой.

При обучении студентов **с нарушениями зрениями** предусмотрено использование в лекционных и учебных аудиториях возможности просмотра удаленных объектов (например, текста на доске или слайда на экране) при помощи видеоувеличителей для удаленного просмотра.

При обучении студентов **с нарушениями опорно-двигательного аппарата** используются

Согласована на портале № 10815

альтернативные устройства ввода информации и другие технические средства приема/передачи учебной информации в доступных формах для студентов с нарушениями опорно-двигательного аппарата, мобильной системы обучения для людей с инвалидностью.

## 14. Фонд оценочных средств

### 14.1. Основные требования к фонду оценочных средств и методические рекомендации

Фонд оценочных средств и типовые контрольные задания, используемые для оценки сформированности и освоения закрепленных за дисциплиной компетенций при проведении текущей, промежуточной аттестации по дисциплине приведен в приложении к рабочей программе.

### 14.2 Требования к фонду оценочных средств для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Для студентов с инвалидностью предусмотрены дополнительные оценочные средства, перечень которых указан в таблице.

**Таблица 14 – Дополнительные средства оценивания для студентов с инвалидностью**

| Категории студентов | Виды дополнительных оценочных средств | Формы контроля и оценки результатов обучения |
|---|---|---|
| С нарушениями слуха | Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы | Преимущественно письменная проверка |
| С нарушениями зрения | Собеседование по вопросам к зачету, опрос по терминам | Преимущественно устная проверка (индивидуально) |
| С нарушениями опорно-двигательного аппарата | Решение дистанционных тестов, контрольные работы, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету | Преимущественно дистанционными методами |
| С ограничениями по общемедицинским показаниям | Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы, устные ответы | Преимущественно проверка методами, исходя из состояния обучающегося на момент проверки |

### 14.3 Методические рекомендации по оценочным средствам для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Для студентов с ОВЗ предусматривается доступная форма предоставления заданий оценочных средств, а именно:

- в печатной форме;
- в печатной форме с увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа;
- методом чтения ассистентом задания вслух;
- предоставление задания с использованием сурдоперевода.

Студентам с инвалидностью увеличивается время на подготовку ответов на контрольные вопросы. Для таких студентов предусматривается доступная форма предоставления ответов на задания, а именно:

- письменно на бумаге;
- набор ответов на компьютере;
- набор ответов с использованием услуг ассистента;
- представление ответов устно.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

**Для лиц с нарушениями зрения:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

Согласована на портале № 10815

**Для лиц с нарушениями слуха:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

**Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

При необходимости для обучающихся с инвалидностью процедура оценивания результатов обучения может проводиться в несколько этапов.

Согласована на портале № 10815

**Приложение 1**

**МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РФ**

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования**

«ТОМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ СИСТЕМ
УПРАВЛЕНИЯ И РАДИОЭЛЕКТРОНИКИ»
(ТУСУР)

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе
_____ П. Е. Троян
«___» _____ 20__ г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

# Риск-менеджмент

Уровень образования: **высшее образование - бакалавриат**
Направление подготовки (специальность): **38.03.02 Менеджмент**
Направленность (профиль): **Финансовый менеджмент**
Форма обучения: **очная**
Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**
Кафедра: **экономики, Кафедра экономики**
Курс: **4**
Семестр: **7**

Учебный план набора 2015 года

Разработчики:

- Доцент каф. Экономики Цибульникова В. Ю.

Зачет: 7 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 10815

## 1. Введение

Фонд оценочных средств (ФОС) является приложением к рабочей программе дисциплины (практики) и представляет собой совокупность контрольно-измерительных материалов (типовые задачи (задания), контрольные работы, тесты и др.) и методов их использования, предназначенных для измерения уровня достижения студентом установленных результатов обучения.

ФОС по дисциплине (практике) используется при проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации студентов.

Перечень закрепленных за дисциплиной (практикой) компетенций приведен в таблице 1.

Таблица 1 – Перечень закрепленных за дисциплиной компетенций

| Код | Формулировка компетенции | Этапы формирования компетенций |
|---|---|---|
| ПК-15 | умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании | Должен знать содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методологию процесса управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками. ;<br>Должен уметь применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками; классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления; проводить выбор между способами передачи рисков, осуществлять соответствующие расчеты к ним; оценивать результативность принятых управленческих решений; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач анализа и оценки рисков. использовать математические и статистические методы расчета уровня рисков, определять привлекательность инвестиционного портфеля, пользоваться инструментами риск-менеджмента. ;<br>Должен владеть методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации |

Согласована на портале № 10815

| | | |
|---|---|---|
| | | выполнения поручений. ; |

Общие характеристики показателей и критериев оценивания компетенций на всех этапах приведены в таблице 2.

Таблица 2 – Общие характеристики показателей и критериев оценивания компетенций по этапам

| Показатели и критерии | Знать | Уметь | Владеть |
|---|---|---|---|
| Отлично (высокий уровень) | Обладает фактическими и теоретическими знаниями в пределах изучаемой области с пониманием границ применимости | Обладает диапазоном практических умений, требуемых для развития творческих решений, абстрагирования проблем | Контролирует работу, проводит оценку, совершенствует действия работы |
| Хорошо (базовый уровень) | Знает факты, принципы, процессы, общие понятия в пределах изучаемой области | Обладает диапазоном практических умений, требуемых для решения определенных проблем в области исследования | Берет ответственность за завершение задач в исследовании, приспосабливает свое поведение к обстоятельствам в решении проблем |
| Удовлетворительно (пороговый уровень) | Обладает базовыми общими знаниями | Обладает основными умениями, требуемыми для выполнения простых задач | Работает при прямом наблюдении |

## 2 Реализация компетенций

### 2.1 Компетенция ПК-15

ПК-15: умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании.

Для формирования компетенции необходимо осуществить ряд этапов. Этапы формирования компетенции, применяемые для этого виды занятий и используемые средства оценивания представлены в таблице 3.

Таблица 3 – Этапы формирования компетенции и используемые средства оценивания

| Состав | Знать | Уметь | Владеть |
|---|---|---|---|
| Содержание этапов | содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методологию процесса управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками. | применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками; классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления; проводить выбор между способами передачи рисков, осуществлять соответствующие расчеты к ним; оценивать результативность | методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками самостоятельной работы, |

Согласована на портале № 10815

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | принятых управленческих решений; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач анализа и оценки рисков. использовать математические и статистические методы расчета уровня рисков, определять привлекательность инвестиционного портфеля, пользоваться инструментами риск-менджмента. | самоорганизации и организации выполнения поручений |
| Виды занятий | • Практические занятия;<br>• Лекции;<br>• Самостоятельная работа; | • Практические занятия;<br>• Лекции;<br>• Самостоятельная работа; | • Самостоятельная работа; |
| Используемые средства оценивания | • Опрос на занятиях;<br>• Расчетная работа;<br>• Тест;<br>• Зачет; | • Опрос на занятиях;<br>• Расчетная работа;<br>• Тест;<br>• Зачет; | • Расчетная работа;<br>• Зачет; |

Формулировка показателей и критериев оценивания данной компетенции приведена в таблице 4.

Таблица 4 – Показатели и критерии оценивания компетенции на этапах

| Состав | Знать | Уметь | Владеть |
|---|---|---|---|
| Отлично (высокий уровень) | • Имеет сформированные и систематические знания о базовых моделях и принципах принятия решений по управлению рисками. Имеет хорошее представление о методологических основах оценки, методах оценки рисков, особенностях оценки рисков для конкретных целей ; | • Показывает успешное и систематическое умение свободно справляться с решением оценочных задач, аргументировано и корректно выполнять устные и письменные задания по управлению рисками. Использует в ответе материал специальной литературы, правильно обосновывает принятые решения.; | • Демонстрирует успешное владение навыками и приемами выполнения практических задач по управлению рисками. Свободно владеет разными способами представления и использования оценочной информацией рисков для целей управления организацией.; |
| Хорошо (базовый уровень) | • Твердо знает сущность о базовых моделях и принципах принятия решений по | • Показывает в целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение | • Способен в достаточной степени логично и аргументировано |

Согласована на портале № 10815

| | | | |
|---|---|---|---|
| | управлению рисками, грамотно и по существу излагает материал дисциплины, не допуская существенных неточностей в ответе на вопросы; | аргументировано и корректно выполнять устные и письменные задания по управлению рисками. Правильно применяет теоретические положения при решении практических задач.; | изложить результаты своих исследований по управлению рисками, как в устной, так и в письменной форме. Владеет необходимыми навыками и приемами по управлению рисками. ; |
| Удовлетворительно (пороговый уровень) | • Знает содержание отдельных направлений о базовых моделях и принципах принятия решений по управлению рисками, имеет представление о методологических основах оценки рисков, методах оценки рисков, особенностях оценки рисков для конкретных целей. Дает определения основных понятий.; | • Показывает неполное, недостаточное сформированное умение проводить оценку рисков. Умеет работать со справочной литературой. Умеет представлять результаты своей работы ; | • Демонстрирует неполное, недостаточное владение навыками по управлению рисками, методами решения оценочных задач по рискам. Способен корректно и понятно изложить свои представления в устной и письменной формах. ; |

## 3 Типовые контрольные задания

Для реализации вышеперечисленных задач обучения используются 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, в следующем составе.

### 3.1 Тестовые задания

– 1. В процессе проведения оценки рисков определяющим является: А. Объект оценки В. Субъект оценки С. Предмет оценки

### 3.2 Темы опросов на занятиях

– 1. Понятие и сущность риска.
– 6. Управление банковскими рисками.
– 2. Определение, функции, организация и правила управление рисками.
– 3. Информационное обеспечение управления рисками.
– 4. Классификация рисков.
– 5. Анализ и оценка степени риска
– 7. Управление рисками, возникающими при инвестировании.
– 8. Система Риск-менеджмента в организации.
– 9. Основы хеджирования рисков.
– 10. Анализ риска в инвестиционной программе.
– 11. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций.
– 12. Рациональный выбор инвестиционного портфеля.
– 13. Методы управления рисками

### 3.3 Темы расчетных работ

– Основные понятия и методологические основы оценки рисков Основные подходы к оценке рисков Оценка рисков предприятия

Согласована на портале № 10815

### 3.4 Зачёт

– 1. Основные определения риска. 2. Дать основную характеристику задач системы управления риском. 3. Классификация риском. 4. Критерии классификации по характеристике взаимодействия с другими рисками. 5. Система управления риском. 6. Цели и задачи управления риском. 7. Этапы управления риском. 8. Общая характеристика идентификации и анализа рисков. 9. Основные принципы оценки риска. 10. Методы управления риском. 11. Методы финансирования рисков. 12. Руководство по разработке, контролю и пересмотру программ управления рисками. 13. Процедуры разработки, контроля и пересмотра программ управления рисками. 14. Критерии классификации по характеристике расходов, связанных с рисками. 15. Классификация по величине риска. 16. Управление рисками от актов незаконного вмешательства в деятельность конкретной организации. 17. Критерии классификации по характеристике подверженности риску. 18. Программа управления рисками 19. Критерии классификации по характеристике опасности.

## 4 Методические материалы

Для обеспечения процесса обучения и решения задач обучения используются следующие материалы:

– методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы фор-мирования компетенций, согласно п. 12 рабочей программы.

### 4.1. Основная литература

1. Управление рисками проектов: Учебное пособие / Кулешова Е. . - 2015. 188 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4956, свободный.

### 4.2. Дополнительная литература

1. Анализ и управление рисками организации : учебное пособие для вузов / Н. А.Рыхтикова. - М. : Форум, 2009. - 239[1] с. : ил., табл. - (Высшее образование). - Библиогр.: с.233-237. - ISBN 978-5-91134-195-4 (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)
2. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций : / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 7-е изд. - М. : Дашков и К°, 2008. - 543[1] с. : ил., портр., табл. - Библиогр.: с. 531-536. - ISBN 978-5-394-00062-1 (наличие в библиотеке ТУСУР - 4 экз.)

### 4.3. Обязательные учебно-методические пособия

1. Управление рисками: Методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе для студентов направления 080200.62 – «Менеджмент», профиль – «Управление проектом» / Кулешова Е. В. - 2014. 38 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4889, свободный.
2. Управление рисками: Методические указания к лабораторным, практическим занятиям и самостоятельной работе для студентов направления 080100.62 – «Экономика», профиль - «Финансы и кредит» / Кулешова Е. В. - 2014. 38 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4890, свободный.

### 4.4. Базы данных, информационно справочные и поисковые системы

1. Научная электронная библиотека http://elibrary.ru
2. Российская государственная библиотека http://www.rsl.ru
3. Российская национальная библиотека http://www.nlr.ru
4. Электронные книги http://books.mlmbiz.ru
5. Публичная Интернет-библиотека http://www.public.ru
6. Библиотека экономики http://www.finansy.ru/publ.htm

Согласована на портале № 10815