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

Управление рисками

Уровень образования: **высшее образование - бакалавриат**
Направление подготовки (специальность): **38.03.01 Экономика**
Направленность (профиль): **Финансы и кредит**
Форма обучения: **очная**
Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**
Кафедра: **экономики, Кафедра экономики**
Курс: **3**
Семестр: **6**
Учебный план набора 2016 года

Распределение рабочего времени

№	Виды учебной деятельности	6 семестр	Всего	Единицы
1	Лекции	36	36	часов
2	Практические занятия	36	36	часов
3	Всего аудиторных занятий	72	72	часов
4	Из них в интерактивной форме	16	16	часов
5	Самостоятельная работа	72	72	часов
6	Всего (без экзамена)	144	144	часов
7	Подготовка и сдача экзамена / зачета	36	36	часов
8	Общая трудоемкость	180	180	часов
		5.0	5.0	З.Е

Экзамен: 6 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 11750

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) 38.03.01 Экономика, утвержденного 2015-11-12 года, рассмотрена и утверждена на заседании кафедры «___» _____ 20__ года, протокол №_____.

Разработчики:

ст.преподаватель каф. ЭМИС _____ Сидоренко М. Г.

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 № 11750

1. Цели и задачи дисциплины

1.1. Цели дисциплины

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 технологии выработки решения в условиях риска и неопределенности и решению типовых задач по управлению финансовыми рисками организации

– научить анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Управление рисками» (Б1.В.ДВ.5.1) относится к блоку 1 (вариативная часть).

Предшествующими дисциплинами, формирующими начальные знания, являются следующие дисциплины: Теория вероятностей и математическая статистика.

Последующими дисциплинами являются: Преддипломная практика, Финансово-экономическая оценка инвестиций.

3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– ПСК-1 способностью проводить аналихз рыночных и специфических рисков, использовать его результаты для принятия управленческих решений;

В результате изучения дисциплины студент должен:

– **знать** методы анализа анализа рыночных и специфических рисков; базовые модели и принципы принятия организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности по управлению рисками; методы анализа информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д ; основы правовой информации в различных сферах деятельности применительно к управлению рисками; способы решения стандартных задач профессиональной деятельности на основе информационной и библиографической культуры с применением информационно-коммуникационных технологий и с учетом основных требований информационной безопасности

– **уметь** проводить анализ рыночных и специфических рисков и использовать результаты анализа для принятия управленческих решений в области управления рисками; анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений; находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности в области управления рисками и готов нести за них ответственность; решать стандартные задачи профессиональной деятельности на основе информационной и библиографической культуры с применением информационно-коммуникационных технологий и с учетом основных требований информационной безопасности; использовать правовую информацию в различных сферах деятельности применительно к управлению рисками

– **владеть** навыками и приемами анализа и интерпретации рыночных и специфических рисков; навыками анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий; навыками принятия управленческих решений на базе полученных сведений; навыками и приемами по управлению рисками для принятия

Согласована на портале № 11750

организационно-управленческих решений; навыками применения информационно-коммуникационных технологий для решения задач по управлению рисками, усвоенными библиографическими знаниями в области управления рисками; способностью использовать основы правовых знаний в различных сферах деятельности в области управления рисками

4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5.0 зачетных единицы и представлена в таблице 4.1.

Таблица 4.1 – Трудоемкость дисциплины

Виды учебной деятельности	Всего часов	Семестры
		6 семестр
Аудиторные занятия (всего)	72	72
Лекции	36	36
Практические занятия	36	36
Из них в интерактивной форме	16	16
Самостоятельная работа (всего)	72	72
Проработка лекционного материала	16	16
Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	10	10
Написание рефератов	10	10
Подготовка к практическим занятиям, семинарам	36	36
Всего (без экзамена)	144	144
Подготовка и сдача экзамена / зачета	36	36
Общая трудоемкость час	180	180
Зачетные Единицы Трудоемкости	5.0	5.0

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	Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	18	18	36	72	ПСК-1
2	Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	18	18	36	72	ПСК-1
	Итого	36	36	72	144	

Согласована на портале № 11750

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
6 семестр			
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Понятие и сущность риска. Определение, функции, организация и правила управление рисками. Информационное обеспечение управления рисками. Классификация рисков. Анализ и оценка степени риска.	18	ПСК-1
	Итого	18	
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Управление рисками Управление банковскими рисками. Управление рисками, возникающими при инвестировании. Риск-менеджмент. Хеджирование рисков. Анализ риска в инвестиционной программе. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Рациональный выбор инвестиционного портфеля.	18	ПСК-1
	Итого	18	
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	Теория вероятностей и математическая статистика	+	+
Последующие дисциплины			
1	Преддипломная практика	+	+
2	Финансово-экономическая оценка инвестиций	+	+

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

Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

Согласована на портале № 11750

представлено в таблице 5.4

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

Компетенции	Виды занятий			Формы контроля
	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	
ПСК-1	+	+	+	Контрольная работа, Компонент своевременности, Реферат, Отчет по практике

6. Интерактивные методы и формы организации обучения

Технологии интерактивного обучения при разных формах занятий в часах приведены в таблице 6.1

Таблица 6.1 – Технологии интерактивного обучения при разных формах занятий в часах

Методы	Интерактивные практические занятия	Интерактивные лекции	Всего
6 семестр			
Работа в команде	4		4
Поисковый метод	4	8	12
Итого за семестр:	8	8	16
Итого	8	8	16

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
6 семестр			
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределѐнности и риска минимаксными методами.	18	ПСК-1
	Итого	18	
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и	Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с	18	ПСК-1

Согласована на портале № 11750

организации системы риск-менеджмента	использованием статистических методов.		
	Итого	18	
Итого за семестр		36	

9. Самостоятельная работа

Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции представлены в таблице 9.1.

Таблица 9.1 - Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции

Названия разделов	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость ч	Формируемые компетенции	Формы контроля
6 семестр				
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	18	ПСК-1	Контрольная работа, Отчет по практике, Реферат
	Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	10		
	Проработка лекционного материала	8		
	Итого	36		
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	18	ПСК-1	Контрольная работа, Отчет по практике, Реферат
	Написание рефератов	10		
	Проработка лекционного материала	8		
	Итого	36		
Итого за семестр		72		
	Подготовка к экзамену / зачету	36		Экзамен
Итого		108		

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
6 семестр				

Согласована на портале № 11750

Компонент своевременности	3	3	3	9
Контрольная работа	10	9	9	28
Отчет по практике	7	7	7	21
Реферат			12	12
Итого максимум за период	20	19	31	70
Экзамен				30
Нарастающим итогом	20	39	70	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
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: 26.01.2017.

12.2. Дополнительная литература

1. Рыхтикова, Наталья Александровна. 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 : 189.52 р. (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)

2. Шапкин, Александр Сергеевич. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций : / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 7-е изд. - М. : Дашков и К°,

Согласована на портале № 11750

2008. - 543[1] с. : ил., портр., табл. - Библиогр.: с. 531-536. - ISBN 978-5-394-00062-1 : 236.41 р. (наличие в библиотеке ТУСУР - 4 экз.)

12.3 Учебно-методические пособия

12.3.1. Обязательные учебно-методические пособия

1. Риск-менеджмент: Методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе для студентов специальностей 080105-Финансы и кредит, 080502-Экономика и управление на предприятии (в машиностроении) / Кулешова Е. В. - 2012. 38 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/3305, дата обращения: 26.01.2017.

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:

- 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.

13.1.2. Материально-техническое обеспечение для практических занятий

Для проведения практических (семинарских) занятий используется учебная аудитория, с количеством посадочных мест не менее 22-24, оборудованная доской и стандартной учебной мебелью

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

Согласована на портале № 11750

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 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;

Согласована на портале № 11750

– 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.

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 № 11750

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

Управление рисками

Уровень образования: **высшее образование - бакалавриат**
Направление подготовки (специальность): **38.03.01 Экономика**
Направленность (профиль): **Финансы и кредит**
Форма обучения: **очная**
Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**
Кафедра: **экономики, Кафедра экономики**
Курс: **3**
Семестр: **6**

Учебный план набора 2016 года

Разработчики:

- ст.преподаватель каф. ЭМИС Сидоренко М. Г.

Экзамен: 6 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 11750

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
ПСК-1	способностью проводить анализ рыночных и специфических рисков, использовать его результаты для принятия управленческих решений	Должен знать методы анализа анализа рыночных и специфических рисков; базовые модели и принципы принятия организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности по управлению рисками; методы анализа информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д ; основы правовой информации в различных сферах деятельности применительно к управлению рисками; способы решения стандартных задач профессиональной деятельности на основе информационной и библиографической культуры с применением информационно-коммуникационных технологий и с учетом основных требований информационной безопасности ; Должен уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков и использовать результаты анализа для принятия управленческих решений в области управления рисками; анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений; находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности в области управления рисками и готов нести за них ответственность; решать стандартные задачи профессиональной деятельности на основе информационной и библиографической культуры с применением информационно-

Согласована на портале № 11750

		коммуникационных технологий и с учетом основных требований информационной безопасности; использовать правовую информацию в различных сферах деятельности применительно к управлению рисками ; Должен владеть навыками и приемами анализа и интерпретации рыночных и специфических рисков; навыками анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий; навыками принятия управленческих решений на базе полученных сведений; навыками и приемами по управлению рисками для принятия организационно-управленческих решений; навыками применения информационно-коммуникационных технологий для решения задач по управлению рисками, усвоенными библиографическими знаниями в области управления рисками; способностью использовать основы правовых знаний в различных сферах деятельности в области управления рисками;

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

Согласована на портале № 11750

2 Реализация компетенций

2.1 Компетенция ПСК-1

ПСК-1: способностью проводить анализ рыночных и специфических рисков, использовать его результаты для принятия управленческих решений.

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	методы анализа анализа рыночных и специфических рисков; методы анализа информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д	проводить анализ рыночных и специфических рисков и использовать результаты анализа для принятия управленческих решений в области управления рисками	навыками и приемами анализа и интерпретации рыночных и специфических рисков
Виды занятий	• Интерактивные практические занятия; • Интерактивные лекции; • Практические занятия; • Лекции; • Самостоятельная работа; • Подготовка и сдача экзамена / зачета;	• Интерактивные практические занятия; • Интерактивные лекции; • Практические занятия; • Лекции; • Самостоятельная работа; • Подготовка и сдача экзамена / зачета;	• Интерактивные практические занятия; • Самостоятельная работа;
Используемые средства оценивания	• Контрольная работа; • Реферат; • Отчет по практике; • Экзамен;	• Контрольная работа; • Реферат; • Отчет по практике; • Экзамен;	• Реферат; • Отчет по практике; • Экзамен;

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)	• методы анализа анализа рыночных и специфических рисков; • методы анализа информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д ;	• свободно проводить анализ рыночных и специфических рисков; • использовать результаты анализа для принятия управленческих решений в области управления рисками; • анализировать и интерпретировать	• свободно владеет навыками и приемами анализа и интерпретации рыночных и специфических рисков; • свободно владеет разными способами представления и использования оценочной информацией рисков

Согласована на портале № 11750

	• имеет хорошее представление о методологических основах оценки, методах оценки рисков, особенностях оценки рисков для конкретных целей ;	финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. в области управления рисками ; • работать со справочной литературой ; • аргументированно и полно представлять результаты своей работы ;	для целей управления организацией ; • навыками принятия управленческих решений на базе полученных сведений об отчетности предприятий ;
Хорошо (базовый уровень)	• методы анализа информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д ; • основной материал дисциплины, не допуская существенных неточностей в ответе на вопросы ;	• проводить анализ рыночных и специфических рисков; • анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. в области управления рискам; • работать со справочной литературой ; • представлять результаты своей работы ;	• навыками и приемами анализа и интерпретации рыночных и специфических рисков,; • разными способами представления и использования оценочной информацией рисков для целей управления организацией ;
Удовлетворительно (пороговый уровень)	• основные методы анализа информации, содержащейся в отчетности предприятий, в области рисков; • основные понятия;	• проводить анализ рыночных и специфических рисков под наблюдением; • представлять результаты своей работы под наблюдением;	• базовыми навыками анализа и интерпретации информации рыночных и специфических рисков, ; • некоторыми способами представления и использования оценочной информацией рисков для целей управления организацией ;

Согласована на портале № 11750

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 Темы рефератов

- Стратегические риски организации
- Методы снижения финансовых рисков компании
- Страхование финансовых рисков как один из аспектов обеспечения экономической безопасности компании
- Методы и инструментарий финансового риск-менеджмента
- Риски в некоторых банковских операциях
- Классификация финансовых рисков

3.2 Экзаменационные вопросы

- Хеджирование как метод снижения риска
- Страхование как метод снижения рисков
- Управление рисками от актов незаконного вмешательства в деятельность конкретной организации
- Дать основную характеристику задач системы управления риском
- Методы финансирования рисков
- Цели и задачи управления риском
- Общая характеристика идентификации и анализа рисков
- Основные определения риска

3.3 Темы контрольных работ

- Инвестиционный проект предполагает затраты 10 000 000 руб. 1 мая 2017 г. и 4 000 000 руб. 1 сентября 2017 г. и последующие денежные поступления: 4 250 000 руб. 1 декабря 2017г., 3 250 000 руб. 1 февраля 2018г. ., 3 250 000 руб. 1 июня 2018 г., и 2 750 000 руб. 1 ноября 2017 г. и2 750 000 руб. 1 февраля 2018 г. Найти чистый приведенный доход, доходность и внутреннюю норму доходности данного проекта. Стоит ли реализовывать такой проект, если ставка непрерывных процентов, выплачиваемых по банковскому счету составляет i=10%?
- Текущая цена акции равна 15 руб. Стоимость акции через 7 дней описывается случайной величиной Y ~ N (16; 1). Рассчитать недельную 95%ную стоимость риска операции по покупке пакета 1000 таких акций и его последующей продаже
- Владелец груза должен выбрать одну из двух альтернатив : страховать груз или не страховать. Риск заключается в том, что с вероятностью 0,1 возможна катастрофа, в результате которой груз будет утрачен. Если груз застрахован, то в случае его утраты владелец теряет стоимость груза (95 000руб.), но получает компенсацию 100 000 руб., если же катастрофы не произошло, он теряет 5000руб, потраченные на страховой полис. Если груз не застрахован, в случае катастрофы теряется его стоимость, при благополучном же исходе владелец не несет никаких расходов. Какое решение принять?

3.4 Вопросы для подготовки к практическим занятиям, семинарам

- Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределѐнности и риска минимаксными методами.
- Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов.

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,

Согласована на портале № 11750

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. Рыхтикова, Наталья Александровна. 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 : 189.52 р. (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)
2. Шапкин, Александр Сергеевич. 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 : 236.41 р. (наличие в библиотеке ТУСУР - 4 экз.)

4.3. Обязательные учебно-методические пособия

1. Риск-менеджмент: Методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе для студентов специальностей 080105-Финансы и кредит, 080502-Экономика и управление на предприятии (в машиностроении) / Кулешова Е. В. - 2012. 38 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/3305, 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 № 11750