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): **38.03.02 Менеджмент**
Направленность (профиль): **Управление проектом**
Форма обучения: **очная**
Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**
Кафедра: **менеджмента, кафедра менеджмента**
Курс: **4**
Семестр: **7**
Учебный план набора 2014 года

Распределение рабочего времени

№	Виды учебной деятельности	7 семестр	Всего	Единицы
1	Лекции	18	18	часов
2	Лабораторные занятия	36	36	часов
3	Всего аудиторных занятий	54	54	часов
4	Из них в интерактивной форме	8	8	часов
5	Самостоятельная работа	90	90	часов
6	Всего (без экзамена)	144	144	часов
7	Общая трудоемкость	144	144	часов
		4.0	4.0	З.Е

Зачет: 7 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 12999

Рассмотрена и одобрена на заседании кафедры
протокол № 6 от «24» 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 2016-01-12 года, рассмотрена и утверждена на заседании кафедры «___» _____ 20__ года, протокол №_____.

Разработчики:

доцент каф. менеджмента _____ Петухов О. Н.

Заведующий обеспечивающей каф. менеджмента _____ Афонасова М. А.

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

Декан ЭФ _____ Богомолова А. В.

Заведующий выпускающей каф. менеджмента _____ Афонасова М. А.

Эксперты:

зав. кафедрой, профессор, д.э.н. кафедра менеджмента ЭФ ТУСУР _____ Афонасова М. А.

Согласована на портале № 12999

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

–

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Управление рисками» (Б1.В.ОД.9) относится к блоку 1 (вариативная часть).

Предшествующими дисциплинами, формирующими начальные знания, являются следующие дисциплины: Финансовый менеджмент, Экономика предприятия, Экономический анализ.

Последующими дисциплинами являются: .

3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– ПК-4 умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации;

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-менджмента.

– **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 4.0 зачетных единицы и представлена в таблице 4.1.

Таблица 4.1 – Трудоемкость дисциплины

Виды учебной деятельности	Всего часов	Семестры

Согласована на портале № 12999

		7 семестр
Аудиторные занятия (всего)	54	54
Лекции	18	18
Лабораторные занятия	36	36
Из них в интерактивной форме	8	8
Самостоятельная работа (всего)	90	90
Оформление отчетов по лабораторным работам	54	54
Проработка лекционного материала	36	36
Всего (без экзамена)	144	144
Общая трудоемкость ч	144	144
Зачетные Единицы Трудоемкости	4.0	4.0

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	Лабораторные работы	Самостоятельная работа	Всего часов (без экзамена)	Формируемые компетенции
7 семестр					
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	9	18	45	72	ПК-4
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	9	18	45	72	ПК-4
Итого за семестр	18	36	90	144	
Итого	18	36	90	144	

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 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Понятие и сущность риска. Определение, функции, организация и правила управление	9	ПК-4

Согласована на портале № 12999

	рисками.Информационное обеспечение управления рисками.Классификация рисков.Анализ и оценка степени риска.		
	Итого	9	
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	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.	9	ПК-4
	Итого	9	
Итого за семестр		18	

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 Финансовый менеджмент	+	+
2 Экономика предприятия	+	+
3 Экономический анализ	+	+

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

Компетенции	Виды занятий			Формы контроля
	Лекции	Лабораторные занятия	Самостоятельная работа	

Согласована на портале № 12999

ПК-4	+	+	+	Собеседование, Отчет по лабораторной работе, Опрос на занятиях, Выступление (доклад) на занятии

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 лабораторные занятия	Всего
7 семестр		
Мозговой штурм	8	8
Итого за семестр:	8	8
Итого	8	8

7. Лабораторные работы

Наименование лабораторных работ приведено в таблице 7.1.

Таблица 7. 1 – Наименование лабораторных работ

Названия разделов	Наименование лабораторных работ	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции
7 семестр			
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности.Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределённости и риска минимаксными методами.	18	ПК-4
	Итого	18	
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов.	18	ПК-4
	Итого	18	
Итого за семестр		36	

8. Практические занятия (семинары)

Не предусмотрено РУП

9. Самостоятельная работа

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

Согласована на портале № 12999

Таблица 9.1 - Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции

Названия разделов	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции	Формы контроля
7 семестр				
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Проработка лекционного материала	18	ПК-4	Выступление (доклад) на занятии, Опрос на занятиях, Отчет по лабораторной работе, Собеседование
	Оформление отчетов по лабораторным работам	27		
	Итого	45		
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Проработка лекционного материала	18	ПК-4	Выступление (доклад) на занятии, Опрос на занятиях, Отчет по лабораторной работе, Собеседование
	Оформление отчетов по лабораторным работам	27		
	Итого	45		
Итого за семестр		90		
Итого		90		

10. Курсовая работа (проект)

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				
Выступление (доклад) на занятии	9	8	8	25
Опрос на занятиях	9	8	8	25
Отчет по лабораторной работе	9	8	8	25
Собеседование	9	8	8	25
Итого максимум за период	36	32	32	100
Нарастающим итогом	36	68	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 № 12999

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. В. - 2015. 188 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4956, дата обращения: 05.02.2017.

12.2. Дополнительная литература

1. Риск-менеджмент : Учебник / В. Н. Вяткин [и др.] ; ред. И. Юргенс. - М. : Дашков и К°, 2003. - 493[3] с. : ил. - Библиогр.: с. 484-493. (наличие в библиотеке ТУСУР - 2 экз.)
2. Риск-менеджмент : Монография / Михаил Анатольевич Рогов. - М. : Финансы и статистика, 2001. - 120 с. : ил. - Библиогр.: с. 117-119. (наличие в библиотеке ТУСУР - 2 экз.)
3. Анализ и управление рисками организации : учебное пособие для вузов / Н. А. Рыхтикова. - М. : Форум, 2009. - 239 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)
4. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций : / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 7-е изд. - М. : Дашков и К°, 2008. - 543 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 4 экз.)

12.3 Учебно-методические пособия

12.3.1. Обязательные учебно-методические пособия

1. 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: 05.02.2017.

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;

Согласована на портале № 12999

– 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 лабораторных работ

Для проведения лабораторных занятий используется учебно-исследовательская вычислительная лаборатория, расположенная по адресу 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 74, 4 этаж, ауд. YYY. Состав оборудования: Учебная мебель; Экран с электроприводом DRAPER BARONET – 1 шт.; Мультимедийный проектор TOSHIBA – 1 шт.; Компьютеры класса не ниже Intel Pentium G3220 (3.0GHz/4Mb)/4GB RAM/ 500GB с широкополосным доступом в Internet, с мониторами типа Samsung 18.5" S19C200N– 18 шт.; Используется лицензионное программное обеспечение, пакеты версией не ниже: Microsoft Windows XP Professional with SP3; Visual Studio 2008 EE with SP1; Microsoft Office Visio 2010; Microsoft SQL-Server 2005; Matlab v6.5

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 альтернативные устройства ввода информации и другие технические средства приема/передачи

Согласована на портале № 12999

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.

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. http://edu.tusur.ru/training/publications/4890

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:

Согласована на портале № 12999

– 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 № 12999

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): **38.03.02 Менеджмент**
Направленность (профиль): **Управление проектом**
Форма обучения: **очная**
Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**
Кафедра: **менеджмента, кафедра менеджмента**
Курс: **4**
Семестр: **7**

Учебный план набора 2014 года

Разработчики:
- доцент каф. менеджмента Петухов О. Н.

Зачет: 7 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 12999

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-4	умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации	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. ; 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-менджмента. ; 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 № 12999

		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-4

ПК-4: умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации.

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	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

Согласована на портале № 12999

		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-менджмента.	риска; навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения поручений.
Виды занятий	• Интерактивные лабораторные занятия; • Лабораторные занятия; • Лекции; • Самостоятельная работа;	• Интерактивные лабораторные занятия; • Лабораторные занятия; • Лекции; • Самостоятельная работа;	• Интерактивные лабораторные занятия; • Лабораторные занятия; • Самостоятельная работа;
Используемые средства оценивания	• Отчет по лабораторной работе; • Опрос на занятиях; • Выступление (доклад) на занятии; • Собеседование; • Зачет;	• Отчет по лабораторной работе; • Опрос на занятиях; • Выступление (доклад) на занятии; • Собеседование; • Зачет;	• Отчет по лабораторной работе; • Выступление (доклад) на занятии; • 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	• 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	• 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.;

Согласована на портале № 12999

	целей;	обосновывает принятые решения ;	
Хорошо (базовый уровень)	• Твердо знает сущность о базовых моделях и принципах принятия решений по управлению рисками, грамотно и по существу излагает материал дисциплины, не допуская существенных неточностей в ответе на вопросы;	• Показывает в целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение аргументировано и корректно выполнять устные и письменные задания по управлению рисками. Правильно применяет теоретические положения при решении практических задач. ;	• Способен в достаточной степени логично и аргументировано 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 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 Вопросы на собеседование

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

3.2 Темы опросов на занятиях

– Понятие и сущность риска. Определение, функции, организация и правила управление рисками. Информационное обеспечение управления рисками. Классификация рисков. Анализ и оценка степени риска.

– Управление рисками, возникающими при инвестировании. Риск-менеджмент. Хеджирование рисков. Анализ риска в инвестиционной программе. Основные понятия и

Согласована на портале № 12999

принципы оценки эффективности инвестиций. Рациональный выбор инвестиционного портфеля.

3.3 Темы докладов

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

3.4 Темы лабораторных работ

– Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределённости и риска минимаксными методами.

– Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов.

3.5 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. 20. Программа управления рисками.

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. В. - 2015. 188 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4956, свободный.

4.2. Дополнительная литература

1. Риск-менеджмент : Учебник / В. Н. Вяткин [и др.] ; ред. И. Юргенс. - М. : Дашков и К°, 2003. - 493[3] с. : ил. - Библиогр.: с. 484-493. (наличие в библиотеке ТУСУР - 2 экз.)
2. Риск-менеджмент : Монография / Михаил Анатольевич Рогов. - М. : Финансы и статистика, 2001. - 120 с. : ил. - Библиогр.: с. 117-119. (наличие в библиотеке ТУСУР - 2 экз.)
3. Анализ и управление рисками организации : учебное пособие для вузов / Н. А. Рыхтикова. - М. : Форум, 2009. - 239 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)
4. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций : / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 7-е изд. - М. : Дашков и К°, 2008. - 543 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 4 экз.)

4.3. Обязательные учебно-методические пособия

1. 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

Согласована на портале № 12999

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 № 12999