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: **заочная**
Факультет: **ЗиВФ, Заочный и вечерний факультет**
Кафедра: **экономики, Кафедра экономики**
Курс: **5**
Семестр: **9, 10**
Учебный план набора 2016 года

Распределение рабочего времени

№	Виды учебной деятельности	9 семестр	10 семестр	Всего	Единицы
1	Лекции	4	8	12	часов
2	Практические занятия	4	8	12	часов
3	Всего аудиторных занятий	8	16	24	часов
4	Самостоятельная работа	28	83	111	часов
5	Всего (без экзамена)	36	99	135	часов
6	Подготовка и сдача экзамена		9	9	часов
7	Общая трудоемкость	36	108	144	часов
		4.0		4.0	З.Е

Контрольные работы: 10 семестр - 1
Экзамен: 10 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 15068

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. экономики	_____	Сидоренко М. Г.
Заведующий обеспечивающей каф. экономики	_____	Рыжкова М. В.

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

Декан ЗиВФ	_____	Осипов И. В.
Заведующий выпускающей каф. экономики	_____	Рыжкова М. В.

Эксперты:

доцент каф.экономики ТУСУР	_____	Земцова Л. В.

Согласована на портале № 15068

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.ОД.15) относится к блоку 1 (вариативная часть).

Предшествующими дисциплинами, формирующими начальные знания, являются следующие дисциплины: Теория вероятностей и математическая статистика, Финансово-экономическая оценка инвестиций, Финансовые вычисления.

Последующими дисциплинами являются: .

3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– ПСК-1 способностью проводить анализз 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; методы анализа информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д ; базовые модели и принципы принятия организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности по управлению рисками.

– **уметь** проводить анализ рыночных и специфических рисков и использовать результаты анализа для принятия управленческих решений в области управления рисками

– **владеть** навыками и приемами анализа и интерпретации рыночных и специфических рисков

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	
		9 семестр	10 семестр
Аудиторные занятия (всего)	24	8	16
Лекции	12	4	8
Практические занятия	12	4	8
Самостоятельная работа (всего)	111	28	83
Проработка лекционного материала	12	4	8

Согласована на портале № 15068

Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	55	18	37
Подготовка к практическим занятиям, семинарам	14	6	8
Выполнение контрольных работ	30		30
Всего (без экзамена)	135	36	99
Подготовка и сдача экзамена	9		9
Общая трудоемкость ч	144	36	108
Зачетные Единицы	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	Практические занятия	Самостоятельная работа	Всего часов (без экзамена)	Формируемые компетенции
9 семестр					
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками	4	4	28	36	ПСК-1
Итого за семестр	4	4	28	36	
10 семестр					
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	8	8	83	99	ПСК-1
Итого за семестр	8	8	83	99	
Итого	12	12	111	135	

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
9 семестр			
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками	Понятие и сущность риска. Определение, функции, организация и правила управление рисками. Информационное обеспечение	4	ПСК-1

Согласована на портале № 15068

	управления рисками. Классификация рисков. Анализ и оценка степени риска.		
	Итого	4	
Итого за семестр		4	
10 семестр			
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.	8	ПСК-1
	Итого	8	
Итого за семестр		8	
Итого		12	

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 представлены 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	+	+
2 Финансово-экономическая оценка инвестиций	+	+
3 Финансовые вычисления	+	+

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 № 15068

Компетенции	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	
ПСК-1	+	+	+	Контрольная работа, Конспект самоподготовки, Расчетная работа

6. Интерактивные методы и формы организации обучения

Не предусмотрено РУП

7. Лабораторные работы

Не предусмотрено РУП

8. Практические занятия (семинары)

Наименование практических занятий (семинаров) приведено в таблице 8.1.

Таблица 8. 1 – Наименование практических занятий (семинаров)

Названия разделов	Наименование практических занятий (семинаров)	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции
9 семестр			
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками	Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределѐнности и риска минимаксными методами.	4	ПСК-1
	Итого	4	
Итого за семестр		4	
10 семестр			
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.	8	ПСК-1
	Итого	8	
Итого за семестр		8	
Итого		12	

9. Самостоятельная работа

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

Согласована на портале № 15068

Таблица 9.1 - Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции

Названия разделов	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции	Формы контроля
9 семестр				
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	6	ПСК-1	Конспект самоподготовки, Расчетная работа
	Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	18		
	Проработка лекционного материала	4		
	Итого	28		
Итого за семестр		28		
10 семестр				
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Выполнение контрольных работ	30	ПСК-1	Конспект самоподготовки, Контрольная работа, Расчетная работа
	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	8		
	Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	37		
	Проработка лекционного материала	8		
	Итого	83		
Итого за семестр		83		
	Подготовка и сдача экзамена	9		Экзамен
Итого		120		

10. Курсовая работа (проект)

Не предусмотрено РУП

11. Рейтинговая система для оценки успеваемости студентов

Не предусмотрено

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: 11.02.2017.

Согласована на портале № 15068

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°, 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: 11.02.2017.

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;
- 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 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.

13.1.3. 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. -

Согласована на портале № 15068

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 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;

Согласована на портале № 15068

– 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.

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 № 15068

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: **заочная**
Факультет: **ЗиВФ, Заочный и вечерний факультет**
Кафедра: **экономики, Кафедра экономики**
Курс: **5**
Семестр: **9, 10**

Учебный план набора 2016 года

Разработчики:

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

Экзамен: 10 семестр

Томск 2017

Согласована на портале № 15068

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; методы анализа информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д ; базовые модели и принципы принятия организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности по управлению рисками.; Должен уметь проводить анализ рыночных и специфических рисков и использовать результаты анализа для принятия управленческих решений в области управления рисками ; Должен владеть навыками и приемами анализа и интерпретации рыночных и специфических рисков;

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 № 15068

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	• Практические занятия; • Лекции; • Самостоятельная работа;	• Практические занятия; • Лекции; • Самостоятельная работа;	• Самостоятельная работа;
Используемые средства оценивания	• Контрольная работа; • Расчетная работа; • Конспект самоподготовки; • Экзамен;	• Контрольная работа; • Расчетная работа; • Конспект самоподготовки; • Экзамен;	• Расчетная работа; • 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 ; • имеет хорошее представление о методологических основах оценки, методах оценки рисков, особенностях оценки	• свободно проводить анализ рыночных и специфических рисков ; • использовать результаты анализа для принятия управленческих решений в области управления рисками ; • анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных	• свободно владеет навыками и приемами анализа и интерпретации рыночных и специфических рисков; • свободно владеет разными способами представления и использования оценочной информацией рисков для целей управления организацией ; • навыками принятия управленческих решений на базе

Согласована на портале № 15068

	рисков для конкретных целей ;	форм собственности, организаций, ведомств и т.д. в области управления рисками ; • работать со справочной литературой; • аргументированно и полно представлять результаты своей работы ;	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 ;

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.

Согласована на портале № 15068

3.1 Вопросы на самоподготовку

- Информационное обеспечение управления рисками
- Управление рисками, возникающими при инвестировании
- Основы хеджирования рисков
- Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций
- Рациональный выбор инвестиционного портфеля
- Классификация рисков
- Управление банковскими рисками

3.2 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%?
- 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?
- 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

3.3 Экзаменационные вопросы

- Основные определения риска
- Дать основную характеристику задач системы управления риском
- Классификация рисков
- Критерии классификации по характеристике взаимодействия с другими рисками.
- Система управления риском.
- Цели и задачи управления риском
- Этапы управления риском
- Общая характеристика идентификации и анализа рисков
- Основные принципы оценки риска
- Методы управления риском

3.4 Темы расчетных работ

- Анализ и оценка степени риска.
- Анализ безубыточности
- Дерево решений
- Матричные игры

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.

Согласована на портале № 15068

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 № 15068