МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

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

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе
_____ П. В. Сенченко
«___» _____ 20__ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Оценка и управление рисками предприятия

Уровень образования: **высшее образование - магистратура**
Направление подготовки / специальность: **38.04.01 Экономика**
Направленность (профиль) / специализация: **Экономика и управление финансами предприятия**
Форма обучения: **заочная**
Факультет: **ЗиВФ, Заочный и вечерний факультет**
Кафедра: **Экон, Кафедра экономики**
Курс: **2**
Семестр: **3, 4**
Учебный план набора 2020 года

Распределение рабочего времени

№	Виды учебной деятельности	3 семестр	4 семестр	Всего	Единицы
1	Лекции	4	4	8	часов
2	Практические занятия	0	8	8	часов
3	Всего аудиторных занятий	4	12	16	часов
4	Самостоятельная работа	68	87	155	часов
5	Всего (без экзамена)	72	99	171	часов
6	Подготовка и сдача экзамена	0	9	9	часов
7	Общая трудоемкость	72	108	180	часов
				5.0	З.Е.

Контрольные работы: 4 семестр - 1
Экзамен: 4 семестр

Томск

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Сенченко П.В.
Должность: Проректор по УР
Дата подписания: 18.12.2019
Уникальный программный ключ:
a1119608-cdff-4455-b54e-5235117c185c

Согласована на портале № 50185

Рассмотрена и одобрена на заседании кафедры
протокол № 11 от «14» 11 2019 г.

ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЯ

Рабочая программа дисциплины составлена с учетом требований федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки (специальности) 38.04.01 Экономика, утвержденного 30.03.2015 года, рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Экон «___» _____ 20__ года, протокол №_____.

Разработчик:
доцент каф. экономики _____ Л. В. Земцова

Заведующий обеспечивающей каф.
Экон _____ В. Ю. Цибульникова

Рабочая программа дисциплины согласована с факультетом и выпускающей кафедрой:

Декан ЗиВФ _____ И. В. Осипов

Заведующий выпускающей каф.
Экон _____ В. Ю. Цибульникова

Эксперты:

доцент каф. экономики _____ Н. Б. Васильковская

Доцент кафедры экономики (Экон) _____ Н. В. Шимко

Согласована на портале № 50185

1. Цели и задачи дисциплины

1.1. Цели дисциплины

изучение теоретических основ управления рисками, принципов и методов оценки рисков, освоения практических навыков принятия решений в условиях риска и неопределенности.

1.2. Задачи дисциплины

– ознакомиться с основными положениями современной теории рисков;

– изучить классификацию предпринимательских рисков и рассмотреть факторы, влияющие на риск;

– приобрести практические навыки, необходимые для объективной оценки предпринимательских рисков;

– изучить существующие методы управления рисками;

– изучить методы моделирования рисковых ситуаций и обоснования решений;

– приобрести умение принимать эффективные управленческие решения по минимизации предпринимательских рисков.

–

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Оценка и управление рисками предприятия» (Б1.В.ОД.7) относится к блоку 1 (вариативная часть).

Предшествующими дисциплинами, формирующими начальные знания, являются: Научно-исследовательская работа (рассред.), Финансово-налоговое планирование и прогнозирование, Экономика и финансы предприятия, Экономика и экономическое поведение.

Последующими дисциплинами являются: Преддипломная практика.

3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– ПК-6 способностью оценивать эффективность проектов с учетом фактора неопределенности;

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

– **знать** общую терминологию в области управления рисками; методы оценки рисков; современные принципы и методы формирования систем управления рисками; содержание процесса управления рисками, его основные этапы; методы оценки рисков инвестиционных проектов.

– **уметь** выявлять, оценивать и анализировать уровень рисков; разрабатывать систему управления рисками; анализировать варианты антикризисного управления с целью поиска оптимального управленческого решения; уметь принимать решения по инвестиционным проектам в условиях риска и неопределенности; моделировать рисковые ситуации; уметь вырабатывать рекомендации по снижению риска.

– **владеть** понятийным аппаратом и основными терминами дисциплины; навыками освоения новых методов научных исследований и практической деятельности; навыками поиска научной информации на бумажных носителях и в сети Интернет; навыками публичной речи, аргументации, ведения дискуссии; навыками самостоятельной работы и самоорганизации

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	
		3 семестр	4 семестр
Аудиторные занятия (всего)	16	4	12
Лекции	8	4	4
Практические занятия	8	0	8

Согласована на портале № 50185

Самостоятельная работа (всего)	155	68	87
Проработка лекционного материала	9	3	6
Подготовка к практическим занятиям, семинарам	65	65	0
Выполнение контрольных работ	81	0	81
Всего (без экзамена)	171	72	99
Подготовка и сдача экзамена	9	0	9
Общая трудоемкость, ч	180	72	108
Зачетные Единицы	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	Лек., ч	Прак. зан., ч	Сам. раб., ч	Всего часов (без экзамена)	Формируемые компетенции
3 семестр					
1 Сущность и виды предпринимательских рисков	1	0	31	32	ПК-6
2 Методы оценки рисков	1	0	26	27	ПК-6
3 Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска	2	0	11	13	ПК-6
Итого за семестр	4	0	68	72	
4 семестр					
4 Моделирование рисковых ситуаций	1	2	27	30	ПК-6
5 Место страхования в защите предпринимательской деятельности	2	2	30	34	ПК-6
6 Хеджирование предпринимательских рисков с использованием современных финансовых инструментов	1	4	30	35	ПК-6
Итого за семестр	4	8	87	99	
Итого	8	8	155	171	

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
3 семестр			
1 Сущность и виды предпринимательских рисков	Основы теории предпринимательских рисков. Классификация предпринимательскихрисков. Объективные и субъективные причины предпринимательского риска.	1	ПК-6

Согласована на портале № 50185

	Функции риска.		
	Итого	1	
2 Методы оценки рисков	Статистические методы исследования и оценки рисков: вероятность, мат. ожидание, дисперсия, среднеквадратическое отклонение, коэффициент вариации. Закон нормального распределения вероятностей. Правило «трех сигм». Метод экспертных оценок. Метод аналогий. Ожидаемая полезность и теория риска Бернулли. Шкалы полезности. Функция полезности фон Неймана-Моргенштерна.	1	ПК-6
	Итого	1	
3 Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска	Имитационная модель оценки риска. Анализ чувствительности результатов проекта к изменению условий его реализации. Метод корректировки на риск денежного потока инвестиционного проекта. Метод корректировки на риск коэффициента дисконтирования инвестиционного проекта.	2	ПК-6
	Итого	2	
Итого за семестр		4	
4 семестр			
4 Моделирование рисковых ситуаций	Понятия финансового риска. Количественная оценка доходности и риска ценной бумаги как математическое ожидание и дисперсии эффективности ценной бумаги. Пример использования неравенства Чебышева для оценки вероятности разорения инвестора. Хеджирование. Моделирование рисковых ситуаций.	1	ПК-6
	Итого	1	
5 Место страхования в защите предпринимательской деятельности	Этапы и методы управления рисками. Понятие страхования предпринимательской деятельности в широком и узком значении. Страхование как один из методов управления риском. Критерии страхуемости рисков. Виды страхования предпринимательской деятельности. Общая характеристика страхования предпринимательских рисков, его особенности. Место и роль страхования предпринимательских рисков в организации защиты от убытков. Основные критерии выбора страховой компании.	2	ПК-6
	Итого	2	
6 Хеджирование предпринимательских	Классификация современных финансовых инструментов. Фьючерсные и опционные	1	ПК-6

Согласована на портале № 50185

рисков с использованием современных финансовых инструментов	контракты на фондовом рынке. Сущность и содержание хеджирования. Кредитные деривативы.		
	Итого	1	
Итого за семестр		4	
Итого		8	

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	3	4	5	6
Предшествующие дисциплины						
1 Научно-исследовательская работа (рассред.)	+	+	+	+	+	+
2 Финансово-налоговое планирование и прогнозирование		+	+	+	+	+
3 Экономика и финансы предприятия		+	+	+		
4 Экономика и экономическое поведение			+			
Последующие дисциплины						
1 Преддипломная практика	+	+	+	+	+	+

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, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

Компетенции	Виды занятий			Формы контроля
	Лек.	Прак. зан.	Сам. раб.	
ПК-6	+	+	+	Контрольная работа, Экзамен, Тест

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
4 семестр			
4 Моделирование	Динамические модели планирования фи-	2	ПК-6

Согласована на портале № 50185

рисковых ситуаций	нансов. Деревья решений. Свойства статистических игр.		
	Итого	2	
5 Место страхования в защите предпринимательской деятельности	Основные понятия и термины, применяемые в страховании. Особенности страхования предпринимательских рисков. Оценка эффективности страхования предпринимательских рисков	2	ПК-6
	Итого	2	
6 Хеджирование предпринимательских рисков с использованием современных финансовых инструментов	Сущность и содержание хеджирования	4	ПК-6
	Итого	4	
Итого за семестр		8	
Итого		8	

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
3 семестр				
1 Сущность и виды предпринимательских рисков	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	30	ПК-6	Тест, Экзамен
	Проработка лекционного материала	1		
	Итого	31		
2 Методы оценки рисков	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	25	ПК-6	Тест, Экзамен
	Проработка лекционного материала	1		
	Итого	26		
3 Принятие решений по инвестиционным проектам в условиях риска	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	10	ПК-6	Тест, Экзамен
	Проработка лекционного материала	1		
	Итого	11		
Итого за семестр		68		
4 семестр				

Согласована на портале № 50185

4 Моделирование рисковых ситуаций	Выполнение контрольных работ	26	ПК-6	Контрольная работа, Тест, Экзамен
	Проработка лекционного материала	1		
	Итого	27		
5 Место страхования в защите предпринимательской деятельности	Выполнение контрольных работ	29	ПК-6	Контрольная работа, Тест, Экзамен
	Проработка лекционного материала	1		
	Итого	30		
6 Хеджирование предпринимательских рисков с использованием современных финансовых инструментов	Выполнение контрольных работ	26	ПК-6	Контрольная работа, Тест, Экзамен
	Проработка лекционного материала	4		
	Итого	30		
Итого за семестр		87		
	Подготовка и сдача экзамена	9		Экзамен
Итого		164		

10. Курсовой проект / курсовая работа

Не предусмотрено РУП.

11. Рейтинговая система для оценки успеваемости обучающихся

Рейтинговая система не используется.

12. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

12.1. Основная литература

1. 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. (наличие в библиотеке ТУСУР - 4 экз.)

2. Анализ и управление рисками организации : учебное пособие для вузов / Н. А. Рыхтикова. - М. : Форум, 2009. - 239[1] с. : ил., табл. - (Высшее образование). (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)

3. Страхование предпринимательских рисков [Электронный ресурс]: Учебное пособие / Земцова Л. В. - 2016. 115 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/6111 (дата обращения: 18.02.2021).

12.2. Дополнительная литература

1. Управление рисками проектов [Электронный ресурс]: Учебное пособие / Кулешова Е. В. - 2015. 188 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4956 (дата обращения: 18.02.2021).

12.3. Учебно-методические пособия

12.3.1. Обязательные учебно-методические пособия

1. Анализ проектных рисков [Электронный ресурс]: Методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе / Кулешова Е. В. - 2012. 39 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/2930 (дата обращения: 18.02.2021).

2. Страхование предпринимательских рисков [Электронный ресурс]: Методические указания к практическим занятиям и самостоятельной работе магистрантов направления 38.04.01 Эко-

Согласована на портале № 50185

номика по профилю «Экономика предпринимательства» / Земцова Л. В. - 2016. 11 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/6156 (дата обращения: 18.02.2021).

12.3.2. Учебно-методические пособия для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Учебно-методические материалы для самостоятельной и аудиторной работы обучающихся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья и 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. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. https://lib.tusur.ru/ru/resursy/bazy-dannyh - Современные профессиональные базы данных (в том числе международные реферативные базы данных научных изданий) и информационные справочные системы
2. https://lib.tusur.ru/ru/resursy/bazy-dannyh/uis-rossiya - Университетская информационная система РОССИЯ
3. http://www.tehnorma.ru/ - информационно-справочная онлайн система «ТЕХНОРМА.RU»

13. Материально-техническое обеспечение дисциплины и требуемое программное обеспечение

13.1. Общие требования к материально-техническому и программному обеспечению дисциплины

13.1.1. Материально-техническое и программное 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 демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации по лекционным разделам дисциплины.

13.1.2. Материально-техническое и программное обеспечение для практических занятий

Учебная аудитория

учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, учебная аудитория для проведения занятий практического типа, учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, помещение для проведения групповых и индивидуальных консультаций, помещение для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации

634045, Томская область, г. Томск, ул. Красноармейская, д. 146, 309 ауд.

Описание имеющегося оборудования:

- Комплект специализированной учебной мебели;
- Рабочее место преподавателя.

Программное обеспечение не требуется.

13.1.3. Материально-техническое и программное обеспечение для самостоятельной работы

Для самостоятельной работы используются учебные аудитории (компьютерные классы), расположенные по адресам:

- 634050, Томская область, г. Томск, Ленина проспект, д. 40, 233 ауд.;

Согласована на портале № 50185

- 634045, Томская область, г. Томск, ул. Красноармейская, д. 146, 201 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 47, 126 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 74, 207 ауд.

Состав оборудования:
- учебная мебель;
- компьютеры класса не ниже ПЭВМ INTEL Celeron D336 2.8ГГц. - 5 шт.;
- компьютеры подключены к сети «Интернет» и обеспечивают доступ в электронную информационно-образовательную среду университета.

Перечень программного обеспечения:
- Microsoft Windows;
- OpenOffice;
- Kaspersky Endpoint Security 10 для Windows;
- 7-Zip;
- Google Chrome.

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

Освоение дисциплины лицами с ограниченными возможностями здоровья и инвалидами осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения.

При занятиях с обучающимися **с нарушениями слуха** предусмотрено использование звукоусиливающей аппаратуры, мультимедийных средств и других технических средств приема/передачи учебной информации в доступных формах, мобильной системы преподавания для обучающихся с инвалидностью, портативной индукционной системы. Учебная аудитория, в которой занимаются обучающиеся с нарушением слуха, оборудована компьютерной техникой, аудиотехникой, видеотехникой, электронной доской, мультимедийной системой.

При занятиях с обучающимися **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 комфортного просмотра.

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

14. Оценочные материалы и методические рекомендации по организации изучения дисциплины

14.1. Содержание оценочных материалов и методические рекомендации

Для оценки степени сформированности и уровня освоения закрепленных за дисциплиной компетенций используются оценочные материалы в составе:

14.1.1. Тестовые задания

Выберите один из правильных вариантов ответов

1. Устранить неопределенность в предпринимательской деятельности

а) возможно

б) невозможно

в) возможно, если хорошо застраховаться

г) возможно, если диверсифицировать свою деятельность

2. Транспортные риски были впервые классифицированы в

а) 1919 г.

б) 1921 г.

в) 1992 г.

г) 2000 г.

3. Тип контракта по передаче рисков, особенностью которого является снижение риска снабжения в условиях инфляционных ожиданий и отсутствия надежных каналов закупки

Согласована на портале № 50185

а) договор долгосрочной аренды;
б) финансовый лизинг;
в) договор факторинга;
г) фьючерсные сделки.
4. К внутренним факторам, влияющим на риск, не относится
а) стратегия фирмы;
б) принципы деятельности фирмы;
в) ресурсы и их использование;
г) состояние экономики
5. Существует закономерность:
а) чем больше риск, тем больше вероятность получения большей прибыли
б) чем больше риск, тем больше вероятность получения больших потерь
в) чем больше риск, тем больше вероятность получения большей прибыли, а также и больших потерь
г) чем ниже риск, тем больше вероятность получения большей прибыли
6. Коммерческий риск не включает
а) риск, связанный с реализацией товаров и услуг
б) риск, связанный с платежеспособностью покупателя
в) риск форс-мажорных обстоятельств
г) риск национализации
7. В настоящее время транспортные риски классифицируются в следующие группы:
а) A, F, C, D
б) E, F, C, D
в) E, F, C,
г) E, C, D
8. В чем заключается диверсификация предпринимательской деятельности?
а) в вероятности потерь, возникающих при вложении фирмой средств в производство новых товаров и услуг, которые, возможно, не найдут ожидаемого спроса на рынке.
б) в вероятности финансовых потерь в результате изменения курса валют, который может произойти в период между заключением контракта и расчетов по нему.
в) в распределении усилий и вложений между разными видами деятельности, не связанными друг с другом.
г) в том, что внедрение новой техники и технологии ведет к опасности техногенных катастроф, причиняющих вред природе, человеку, производству.
9. По какому виду договора страхованию подлежит имущество, принятое организациями на комиссию, хранение, для переработки, ремонта и т.п.:
а) дополнительному
б) основному
в) специальному
10. Какое имущество из нижеперечисленного принимаются на страхование?
а) взрывчатые вещества
б) животные в местностях, где уста¬новлен карантин
в) урожай сельскохозяйственных культур
г) имущество, находящееся в аварийном состоянии
11. Каско страховое – это
а) страхование грузов, перевозимых любым видом транс¬порта, без страхования самого средства транспорта
б) страхование средства транспорта без страхования пере¬возимого груза.
в) страхование судовла¬дельцев
г) свидетельство о страховании, выдаваемое броке¬ром страхователю и подтверждающее заключение договора страхования с указа¬нием списка страховщиков.
12. Карго страховое – это
а) страхование грузов, перевозимых любым видом транс¬порта, без страхования самого средства транспорта

Согласована на портале № 50185

б) страхование средства транспорта без страхования пере¬возимого груза.

в) страхование судовла¬дельцев

г) свидетельство о страховании, выдаваемое броке¬ром страхователю и подтверждающее заключение договора страхования с указа¬нием списка страховщиков.

13. Не принимаются на страхование (несколько вариантов ответа)

а) цен¬ные бумаги

б) рукописи

в) изделия из драгоценных ме¬таллов

14. Сумма, выплачиваемая страхователю при досроч¬ном расторжении страхового договора с учетом размера уплачен¬ных им до этого страховых взносов, называется …

а) полисом

б) рентой

в) бонусом

г) выкупной ценой

15. Участие страхователя в прибыли страховой компании, по¬лученной от инвестирования страховых резервов называется

а) полисом

б) рентой

в) бонусом

г) выкупной ценой

14.1.2. Экзаменационные вопросы

Общая характеристика рисков и их классификация.

Этапы и методы управления предпринимательскими рисками.

Методы прогноза риска. Показатели достоверности прогноза..

Процесс управления риском.

Принципы принятия решений об управлении рисками.

Классическая схема принятия решения.

Методы принятия рациональных решений.

Методы оптимизации решений по управлению рисками.

Парадигма риск-менеджмента на уровне предприятия.

Классификация рисков в проектах.

Классификация стандартов управления рисками.

Понятие рыночного риска. Классификация рыночных рисков.

Портфельный подход к системе управления рисками.

Современные проблемы риск-менеджмента в России.

Понятие кредитного риска. Классификация кредитных рисков.

Классический анализ кредитоспособности заемщика.

Модели оценки кредитоспособности.

Критерии страхуемости предпринимательских рисков.

Страхование как один из методов управления риском. Критерии выбора страховой компании.

Модель оценки эффективности передачи финансового риска предприятия страховщику.

Классификация современных финансовых инструментов.

Фьючерсные и опционные контракты на фондовом рынке.

Сущность и содержание хеджирования.

Техника короткого хеджирования фьючерсными контрактами.

Техника длинного хеджирования фьючерсными контрактами.

Понятие коэффициента хеджирования и порядок его расчёта.

Определение теоретического коэффициента хеджирования и область его применения.

14.1.3. Темы контрольных работ

1. Современные классификации предпринимательских рисков
2. Организация управления риском на предприятии (схема, методы воздействия на риск).
3. Функции риск-менеджера в финансовой службе предприятия.
4. Методы оценки риска (построение деревьев событий, события – последствия, деревья

Согласована на портале № 50185

отказов, индексы опасности).

5. Основные подходы к оценке риска в теории игр

6. Финансовые и коммерческие риски: сущность и характеристика.

7. Кредитные риски: сущность и способы снижения.

8. Характеристика основных проявлений банковских рисков: кредитного, процентного, депозитного и валютного

9. Оценка экономической эффективности страхования предпринимательских рисков

10. Экономическая сущность дебиторного риска и инструменты его страхования

11. Риск отказа от платежа («риск делькредере») во внешней торговле. Инструменты страхования (международный простой и переводной вексель).

12. Политический и трансфертный риск: сущность, причины возникновения и средства нейтрализации

13. Экспортное форфейтирование: участники и их роль в страховании от политических, дебиторных и трансфертных рисков.

14. Государственное кредитование экспортного риска и организационные формы такой системы страхования.

15. Страхование экспортного риска до и после экспедиции.

16. Предпринимательские риски: виды и причины их возникновения.

17. Страховые риски: типы, причины их возникновения, способы минимизации

18. Технические и промышленные риски, их характеристика и методы минимизации.

19. Общая схема анализа и управления рисками. Методы воздействия на риск

20.Хеджирование как метод управления рисками

1. Современные классификации предпринимательских рисков

2. Организация управления риском на предприятии (схема, методы воздействия на риск).

3. Функции риск-менеджера в финансовой службе предприятия.

4. Методы оценки риска (построение деревьев событий, события – последствия, деревья отказов, индексы опасности).

5. Основные подходы к оценке риска в теории игр

6. Финансовые и коммерческие риски: сущность и характеристика.

7. Кредитные риски: сущность и способы снижения.

8. Характеристика основных проявлений банковских рисков: кредитного, процентного, депозитного и валютного

9. Оценка экономической эффективности страхования предпринимательских рисков

10. Экономическая сущность дебиторного риска и инструменты его страхования

11. Риск отказа от платежа («риск делькредере») во внешней торговле. Инструменты страхования (международный простой и переводной вексель).

12. Политический и трансфертный риск: сущность, причины возникновения и средства нейтрализации

13. Экспортное форфейтирование: участники и их роль в страховании от политических, дебиторных и трансфертных рисков.

14. Государственное кредитование экспортного риска и организационные формы такой системы страхования.

15. Страхование экспортного риска до и после экспедиции.

16. Предпринимательские риски: виды и причины их возникновения.

17. Страховые риски: типы, причины их возникновения, способы минимизации

18. Технические и промышленные риски, их характеристика и методы минимизации.

19. Общая схема анализа и управления рисками. Методы воздействия на риск

20.Хеджирование как метод управления рисками

14.2. Требования к оценочным материалам для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предусмотрены дополнительные оценочные материалы, перечень которых указан в таблице 14.

Согласована на портале № 50185

Таблица 14 – Дополнительные материалы оценивания для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Категории обучающихся	Виды дополнительных оценочных материалов	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 материалам для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов 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.

Лицам с ограниченными возможностями здоровья и инвалидам увеличивается время на подготовку ответов на контрольные вопросы. Для таких обучающихся 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 лиц с ограниченными возможностями здоровья и 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 лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения может проводиться в несколько этапов.

Согласована на портале № 50185