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 УР
_____Сенченко П.В.
«13» _____12_____ 2023 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Уровень образования: **высшее образование - магистратура**
Направление подготовки / специальность: **38.04.02 Менеджмент**
Направленность (профиль) / специализация: **Менеджмент в IT-сфере**
Форма обучения: **очная**
Факультет: **Экономический факультет (ЭФ)**
Кафедра: **Кафедра менеджмента (Менеджмента)**
Курс: **1**
Семестр: **1**
Учебный план набора 2024 года

Объем дисциплины и виды учебной деятельности

Виды учебной деятельности	1 семестр	Всего	Единицы
Лекционные занятия	12	12	часов
Практические занятия	12	12	часов
Самостоятельная работа	156	156	часов
Подготовка и сдача экзамена	36	36	часов
Общая трудоемкость (включая промежуточную аттестацию)	216	216	часов
	6	6	з.е.

Формы промежуточной аттестация	Семестр
Экзамен	1

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Сенченко П.В.
Должность: Проректор по УР
Дата подписания: 13.12.2023
Уникальный программный ключ:
a1119608-cdff-4455-b54e-5235117c185c

Томск

Согласована на портале № 80557

1. Общие положения

1.1. Цели дисциплины

1. Формирование у студентов знаний о методах оценки, анализа и управления рисками, а также умений отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности.

1.2. Задачи дисциплины

1. Сформировать знания у обучающихся об основных элементах системы управления финансовыми рисками организации, приемах управления предпринимательскими и финансовыми рисками предприятия, о методах и моделях, используемых в анализе, оптимизации финансовых операций с учетом факторов риска.
2. Сформировать навыки использования в практической деятельности современных специальных экономико-математических инструментов анализа и оценки риска.
3. Сформировать навыки отбора подходящих методов воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Блок дисциплин: Б1. Дисциплины (модули).
Часть блока дисциплин: Обязательная часть.
Модуль дисциплин: Модуль направления подготовки (hard skills – HS).
Индекс дисциплины: Б1.О.02.03.
Реализуется с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий.

3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО и основной образовательной программой (таблица 3.1):
Таблица 3.1 – Компетенции и индикаторы их достижения

Компетенция	Индикаторы достижения компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине
Универсальные компетенции		

Согласована на портале № 80557

УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	УК-1.1. Знает методы осуществления критического анализа проблемных ситуаций на основе системного подхода	Знает 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.
	УК-1.2. Умеет разрабатывать стратегии действий на основе критического анализа проблемных ситуаций	Способен 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; определять привлекательность инвестиционного портфеля; пользоваться инструментами риск-менеджмента; отбирать и применять методы воздействия на отдельные виды рисков, оценивать результативность принятых управленческих решений.
	УК-1.3. Владеет навыками разработки стратегии действий на основе системного подхода	Владеет методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками использования методов воздействия на отдельные виды рисков.
Общепрофессиональные компетенции		
-	-	-
Профессиональные компетенции		
-	-	-

4. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость дисциплины составляет 6 зачетных единиц, 216 академических часов.

Распределение трудоемкости дисциплины по видам учебной деятельности представлено в таблице 4.1.

Таблица 4.1 – Трудоемкость дисциплины по видам учебной деятельности

Виды учебной деятельности	Всего часов	Семестры
		1 семестр
Контактная аудиторная работа обучающихся с преподавателем, всего	24	24
Лекционные занятия	12	12
Практические занятия	12	12

Согласована на портале № 80557

Самостоятельная работа обучающихся, в т.ч. контактная внеаудиторная работа обучающихся с преподавателем, всего	156	156
Подготовка к тестированию	36	36
Подготовка к устному опросу / собеседованию	60	60
Написание отчета по практическому занятию (семинару)	60	60
Подготовка и сдача экзамена	36	36
Общая трудоемкость (в часах)	216	216
Общая трудоемкость (в з.е.)	6	6

5. Структура и содержание дисциплины

5.1. Разделы (темы) дисциплины и виды учебной деятельности

Структура дисциплины по разделам (темам) и видам учебной деятельности приведена в таблице 5.1.

Таблица 5.1 – Разделы (темы) дисциплины и виды учебной деятельности

Названия разделов (тем) дисциплины	Лек. зан., ч	Прак. зан., ч	Сам. раб., ч	Всего часов (без экзамена)	Формируемые компетенции
1 семестр					
1 Целостное управление рисками	2	-	16	18	УК-1
2 Риск как объект диагностики и оценки	2	2	31	35	УК-1
3 Управленческий механизм риск-менеджмента	2	4	31	37	УК-1
4 Человеческий аспект управления рисками	2	-	16	18	УК-1
5 Финансовый аспект управления рисками	2	2	31	35	УК-1
6 Инструментальный ящик риск-менеджера	2	4	31	37	УК-1
Итого за семестр	12	12	156	180	
Итого	12	12	156	180	

5.2. Содержание разделов (тем) дисциплины

Содержание разделов (тем) дисциплины (в т.ч. по лекциям) приведено в таблице 5.2.

Таблица 5.2 – Содержание разделов (тем) дисциплины (в т.ч. по лекциям)

Названия разделов (тем) дисциплины	Содержание разделов (тем) дисциплины (в т.ч. по лекциям)	Трудоемкость (лекционные занятия), ч	Формируемые компетенции
1 семестр			
1 Целостное управление рисками	Смысл и ситуация рискования. Рисковый ландшафт и рисковые характеристики организации. Феномен риска. Аспекты риска, потерь.	2	УК-1
	Итого	2	

Согласована на портале № 80557

2 Риск как объект диагностики и оценки	Основы управленческой диагностики рисков. Формула риска. Таксономия рисков. Пирамида риска: факторы, симптомы, бифуркации, контроль.	2	УК-1
	Итого	2	
3 Управленческий механизм риск-менеджмента	Модель функции риск-менеджмента в управлении. Распределение обязанностей по управлению рисками. Защита от стратегических рисков. Рутинный риск-менеджмент. Чрезвычайная ситуация.	2	УК-1
	Итого	2	
4 Человеческий аспект управления рисками	Индивидуальное и групповое поведение людей и управление рисками. Психологические особенности реакции на риск. Риски работы с кадрами. Оценка рискового аппетита сотрудников.	2	УК-1
	Итого	2	
5 Финансовый аспект управления рисками	Риск, доходность и стоимость фирмы. Методы финансирования программы управления риском. Финансовые инструменты управления рисками.	2	УК-1
	Итого	2	
6 Инструментальный ящик риск-менеджера	Методический арсенал диагностики. Инструментарий управления рисками. Методики оценки политических рисков.	2	УК-1
	Итого	2	
Итого за семестр		12	
Итого		12	

5.3. Практические занятия (семинары)

Наименование практических занятий (семинаров) приведено в таблице 5.3.

Таблица 5.3. – Наименование практических занятий (семинаров)

Названия разделов (тем) дисциплины	Наименование практических занятий (семинаров)	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции
1 семестр			
2 Риск как объект диагностики и оценки	Основы оценки риска: использование финансовых и статистических показателей	2	УК-1
	Итого	2	
3 Управленческий механизм риск-менеджмента	Анализ и оценка степени риска. Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности	4	УК-1
	Итого	4	

Согласована на портале № 80557

5 Финансовый аспект управления рисками	Анализ системы управления рисками в организации	2	УК-1
	Итого	2	
6 Инструментальный ящик риск-менеджера	Комплексная оценка рисков проекта с учетом внешнеэкономических факторов	4	УК-1
	Итого	4	
Итого за семестр		12	
Итого		12	

5.4. Лабораторные занятия

Не предусмотрено учебным планом

5.5. Курсовой проект / курсовая работа

Не предусмотрено учебным планом

5.6. Самостоятельная работа

Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции представлены в таблице 5.6.

Таблица 5.6. – Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции

Названия разделов (тем) дисциплины	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции	Формы контроля
1 семестр				
1 Целостное управление рисками	Подготовка к тестированию	6	УК-1	Тестирование
	Подготовка к устному опросу / собеседованию	10	УК-1	Устный опрос / собеседование
	Итого	16		
2 Риск как объект диагностики и оценки	Подготовка к тестированию	6	УК-1	Тестирование
	Подготовка к устному опросу / собеседованию	10	УК-1	Устный опрос / собеседование
	Написание отчета по практическому занятию (семинару)	15	УК-1	Отчет по практическому занятию (семинару)
	Итого	31		
3 Управленческий механизм риск-менеджмента	Подготовка к тестированию	6	УК-1	Тестирование
	Подготовка к устному опросу / собеседованию	10	УК-1	Устный опрос / собеседование
	Написание отчета по практическому занятию (семинару)	15	УК-1	Отчет по практическому занятию (семинару)
	Итого	31		

Согласована на портале № 80557

4 Человеческий аспект управления рисками	Подготовка к тестированию	6	УК-1	Тестирование
	Подготовка к устному опросу / собеседованию	10	УК-1	Устный опрос / собеседование
	Итого	16		
5 Финансовый аспект управления рисками	Подготовка к тестированию	6	УК-1	Тестирование
	Подготовка к устному опросу / собеседованию	10	УК-1	Устный опрос / собеседование
	Написание отчета по практическому занятию (семинару)	15	УК-1	Отчет по практическому занятию (семинару)
	Итого	31		
6 Инструментальный ящик риск-менеджера	Подготовка к тестированию	6	УК-1	Тестирование
	Подготовка к устному опросу / собеседованию	10	УК-1	Устный опрос / собеседование
	Написание отчета по практическому занятию (семинару)	15	УК-1	Отчет по практическому занятию (семинару)
	Итого	31		
Итого за семестр		156		
	Подготовка и сдача экзамена	36		Экзамен
Итого		192		

5.7. Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов учебной деятельности

Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов учебной деятельности представлено в таблице 5.7.

Таблица 5.7 – Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

Формируемые компетенции	Виды учебной деятельности			Формы контроля
	Лек. зан.	Прак. зан.	Сам. раб.	
УК-1	+	+	+	Отчет по практическому занятию (семинару), Тестирование, Устный опрос / собеседование, Экзамен

6. Рейтинговая система для оценки успеваемости обучающихся

6.1. Балльные оценки для форм контроля

Балльные оценки для форм контроля представлены в таблице 6.1.

Таблица 6.1 – Балльные оценки

Согласована на портале № 80557

Формы контроля	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
1 семестр				
Устный опрос / собеседование	10	10	10	30
Тестирование	5	5	5	15
Отчет по практическому занятию (семинару)	5	10	10	25
Экзамен				30
Итого максимум за период	20	25	25	100
Нарастающим итогом	20	45	70	100

6.2. Пересчет баллов в оценки за текущий контроль

Пересчет баллов в оценки за текущий контроль представлен в таблице 6.2.

Таблица 6.2 – Пересчет баллов в оценки за текущий контроль

Баллы на дату текущего контроля	Оценка
≥ 90% от максимальной суммы баллов на дату ТК	5
От 70% до 89% от максимальной суммы баллов на дату ТК	4
От 60% до 69% от максимальной суммы баллов на дату ТК	3
< 60% от максимальной суммы баллов на дату ТК	2

6.3. Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку представлен в таблице 6.3.

Таблица 6.3 – Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

Оценка	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)

7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

7.1. Основная литература

1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 365 с. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: https://urait.ru/bcode/536005.

7.2. Дополнительная литература

1. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник для вузов / Т. Г. Касьяненко. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 456 с. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: https://urait.ru/bcode/554991.

Согласована на портале № 80557

2. Управление финансовыми рисками. Практический курс : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: https://urait.ru/bcode/534353.

3. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 569 с. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: https://urait.ru/bcode/536964.

7.3. Учебно-методические пособия

7.3.1. Обязательные учебно-методические пособия

1. Риск-менеджмент: Методические указания для практических занятий и самостоятельной работы / В. Ю. Цибульникова - 2018. 58 с. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/8441.

7.3.2. 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.

7.4. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. При изучении дисциплины рекомендуется обращаться к современным базам данных, информационно-справочным и поисковым системам, к которым у ТУСУРа открыт доступ: https://lib.tusur.ru/ru/resursy/bazy-dannyh.

8. Материально-техническое и программное обеспечение дисциплины

8.1. 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 достаточным количеством посадочных мест для учебной группы, оборудованная доской и стандартной учебной мебелью. Имеются мультимедийное оборудование и учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации по лекционным разделам дисциплины.

8.2. 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, 501 ауд.

Описание имеющегося оборудования:

- Проектор Acer X1128H;
- Проекционный экран;
- Магнитно-маркерная доска (настенная);
- Магнитно-маркерная доска (на ножках);
- Комплект специализированной учебной мебели;
- Рабочее место преподавателя.

Согласована на портале № 80557

Программное обеспечение:
- 7-Zip;
- FoxitReader;
- Google Chrome;
- Mozilla Firefox;
- OpenOffice;
- Консультант Плюс;

8.3. 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.;
- 634045, Томская область, г. Томск, ул. Красноармейская, д. 146, 209 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 47, 126 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 74, 207 ауд.

Описание имеющегося оборудования:
- учебная мебель;
- компьютеры;
- компьютеры подключены к сети «Интернет» и обеспечивают доступ в электронную информационно-образовательную среду ТУСУРа.

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

8.4. 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 зрения** 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.

9. Оценочные материалы и методические рекомендации по организации изучения дисциплины

9.1. Содержание оценочных материалов для текущего контроля и промежуточной аттестации

Для оценки степени сформированности и уровня освоения закрепленных за дисциплиной компетенций используются оценочные материалы, представленные в таблице 9.1.

Таблица 9.1 – Формы контроля и оценочные материалы

Согласована на портале № 80557

Названия разделов (тем) дисциплины	Формируемые компетенции	Формы контроля	Оценочные материалы (ОМ)
1 Целостное управление рисками	УК-1	Устный опрос / собеседование	Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования
		Тестирование	Примерный перечень тестовых заданий
		Экзамен	Перечень экзаменационных вопросов
2 Риск как объект диагностики и оценки	УК-1	Устный опрос / собеседование	Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования
		Тестирование	Примерный перечень тестовых заданий
		Экзамен	Перечень экзаменационных вопросов
		Отчет по практическому занятию (семинару)	Темы практических занятий
3 Управленческий механизм риск-менеджмента	УК-1	Устный опрос / собеседование	Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования
		Тестирование	Примерный перечень тестовых заданий
		Экзамен	Перечень экзаменационных вопросов
		Отчет по практическому занятию (семинару)	Темы практических занятий
4 Человеческий аспект управления рисками	УК-1	Устный опрос / собеседование	Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования
		Тестирование	Примерный перечень тестовых заданий
		Экзамен	Перечень экзаменационных вопросов
5 Финансовый аспект управления рисками	УК-1	Устный опрос / собеседование	Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования
		Тестирование	Примерный перечень тестовых заданий
		Экзамен	Перечень экзаменационных вопросов
		Отчет по практическому занятию (семинару)	Темы практических занятий

Согласована на портале № 80557

6 Инструментальный ящик риск-менеджера	УК-1	Устный опрос / собеседование	Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования
		Тестирование	Примерный перечень тестовых заданий
		Экзамен	Перечень экзаменационных вопросов
		Отчет по практическому занятию (семинару)	Темы практических занятий

Шкала оценки сформированности отдельных планируемых результатов обучения по дисциплине приведена в таблице 9.2.

Таблица 9.2 – Шкала оценки сформированности планируемых результатов обучения по дисциплине

Оценка	Баллы за ОМ	Формулировка требований к степени сформированности планируемых результатов обучения		
		знать	уметь	владеть
2 (неудовлетворительно)	< 60% от максимальной суммы баллов	отсутствие знаний или фрагментарные знания	отсутствие умений или частично освоенное умение	отсутствие навыков или фрагментарные применение навыков
3 (удовлетворительно)	от 60% до 69% от максимальной суммы баллов	общие, но не структурированные знания	в целом успешно, но не систематически осуществляемое умение	в целом успешное, но не систематическое применение навыков
4 (хорошо)	от 70% до 89% от максимальной суммы баллов	сформированные, но содержащие отдельные проблемы знания	в целом успешное, но содержащие отдельные пробелы умение	в целом успешное, но содержащие отдельные пробелы применение навыков
5 (отлично)	≥ 90% от максимальной суммы баллов	сформированные систематические знания	сформированное умение	успешное и систематическое применение навыков

Шкала комплексной оценки сформированности компетенций приведена в таблице 9.3.

Таблица 9.3 – Шкала комплексной оценки сформированности компетенций

Оценка	Формулировка требований к степени компетенции
2 (неудовлетворительно)	Не имеет необходимых представлений о проверяемом материале или Знать на уровне **ориентирования**, представлений. Обучающийся знает основные признаки или термины изучаемого элемента содержания, их отнесенность к определенной науке, отрасли или объектам, узнает в текстах, изображениях или схемах и знает, к каким источникам нужно обращаться для более детального его усвоения.

Согласована на портале № 80557

3 (удовлетворительно)	Знать и уметь на **репродуктивном** уровне. Обучающихся знает изученный элемент содержания репродуктивно: произвольно воспроизводит свои знания устно, письменно или в демонстрируемых действиях.
4 (хорошо)	Знать, уметь, владеть на **аналитическом** уровне. Зная на репродуктивном уровне, указывать на особенности и взаимосвязи изученных объектов, на их достоинства, ограничения, историю и перспективы развития и особенности для разных объектов усвоения.
5 (отлично)	Знать, уметь, владеть на **системном** уровне. Обучающийся знает изученный элемент содержания системно, произвольно и доказательно воспроизводит свои знания устно, письменно или в демонстрируемых действиях, учитывая и указывая связи и зависимости между этим элементом и другими элементами содержания дисциплины, его значимость в содержании дисциплины.

9.1.1. Примерный перечень тестовых заданий

1. Риск – это...
   1) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели;
   2) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна;
   3)следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера;
   4) все выше перечисленное.
2. Отметьте потери, которые можно отнести к трудовым:
   1) потери рабочего времени;
   2) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию;
   3) уплата дополнительных налогов;
   4) невыполнение сроков сдачи объекта.
3. Анализ риска – это...
   1) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия;
   2) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты;
   3) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик;
   4) нет верного ответа.
4. Идентификация риска – это…
   1) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия;
   2) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик;
   3) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты;
   4) нет верного ответа.
5. Стратегические риски для быстро растущих компаний:
   1) запаздывание в адаптации своих компетенций;
   2) концентрация усилий на среднесрочных и долгосрочных стратегических инициативах;
   3) попытка гарантировать конкурентное преимущество в сферах бизнеса и товарных группах будущего;
   4) попытки компании достичь преимущества одновременно по издержкам, за счет дифференциации и на основе сфокусированной стратегии.

Согласована на портале № 80557

6. Систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия называется:
   1) идентификацией рисков;
   2) анализом рисков;
   3) классификацией рисков;
   4) планированием рисков.
7. Какой из перечисленных методов оценки риска основан на расчетах и анализе статистических показателей?
   1) вероятностный метод;
   2) построение дерева решений;
   3) метод сценариев;
   4) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости.
8. Какой из перечисленных методов оценки риска дает представление о наиболее критических факторах инвестиционного проекта?
   1) построение дерева решений;
   2) метод сценариев;
   3) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;
   4) анализ чувствительности.
9. Какой из перечисленных методов оценки риска реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков?
   1) построение дерева решений;
   2) метод сценариев;
   3) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;
   4) анализ чувствительности.
10. Какой из перечисленных методов оценки риска используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий?
    1) вероятностный метод;
    2) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;
    3) построение дерева решений;
    4) метод сценариев.

9.1.2. Перечень экзаменационных вопросов

1. Понятие риска и неопределенности.
2. Общая характеристика хозяйственных рисков, их классификация.
3. Концепции управления рисками.
4. Стратегия управления рисками.
5. Сущность риск-менеджмента, его цели и задачи.
6. Объекты и субъекты риск-менеджмента.
7. Принципы риск-менеджмента.
8. Содержание политики управления финансовыми рисками.
9. Методы управления финансовыми рисками.
10. Методы оценки финансовых рисков.

9.1.3. Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования

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

Согласована на портале № 80557

9.1.4. Темы практических занятий

1. Основы оценки риска: использование финансовых и статистических показателей
2. Анализ и оценка степени риска. Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности
3. Анализ системы управления рисками в организации
4. Комплексная оценка рисков проекта с учетом внешнеэкономических факторов

9.2. Методические рекомендации

Учебный материал излагается в форме, предполагающей самостоятельное мышление студентов, самообразование. При этом самостоятельная работа студентов играет решающую роль в ходе всего учебного процесса.

Начать изучение дисциплины необходимо со знакомства с рабочей программой, списком учебно-методического и программного обеспечения. Самостоятельная работа студента включает работу с учебными материалами, выполнение контрольных мероприятий, предусмотренных учебным планом.

В процессе изучения дисциплины для лучшего освоения материала необходимо регулярно обращаться к рекомендуемой литературе и источникам, указанным в учебных материалах; пользоваться через кабинет студента на сайте Университета образовательными ресурсами электронно-библиотечной системы, а также общедоступными интернет-порталами, содержащими научно-популярные и специализированные материалы, посвященные различным аспектам учебной дисциплины.

При самостоятельном изучении тем следуйте рекомендациям:

– чтение или просмотр материала осуществляйте со скоростью, достаточной для индивидуального понимания и освоения материала, выделяя основные идеи; на основании изученного составить тезисы. Освоив материал, попытаться соотнести теорию с примерами из практики;

– если в тексте встречаются незнакомые или малознакомые термины, следует выяснить их значение для понимания дальнейшего материала;

– осмысливайте прочитанное и изученное, отвечайте на предложенные вопросы.

Студенты могут получать индивидуальные консультации, в т.ч. с использованием средств телекоммуникации.

По дисциплине могут проводиться дополнительные занятия, в т.ч. в форме вебинаров. Расписание вебинаров и записи вебинаров публикуются в электронном курсе / электронном журнале по дисциплине.

9.3. 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 9.4.

Таблица 9.4 – 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

Согласована на портале № 80557

С ограничениями по общемедицинским показаниям	Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы, устные ответы	Преимущественно проверка методами, определяющимися исходя из состояния обучающегося на момент проверки

9.4. 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 № 80557

ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЯ

Рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Менеджмента
протокол № 11 от «23» 11 2023 г.

СОГЛАСОВАНО:

Должность	Инициалы, фамилия	Подпись
Заведующий выпускающей каф. Менеджмента	М.А. Афонасова	Согласовано, b62b44b3-4a58-4b2a-82c7-683ac1767431
Заведующий обеспечивающей каф. Менеджмента	М.А. Афонасова	Согласовано, b62b44b3-4a58-4b2a-82c7-683ac1767431
Начальник учебного управления	И.А. Лариошина	Согласовано, c3195437-a02f-4972-a7c6-ab6ee1f21e73

ЭКСПЕРТЫ:

Профессор, каф. менеджмента	М.А. Афонасова	Согласовано, b62b44b3-4a58-4b2a-82c7-683ac1767431
Доцент, каф. менеджмента	Т.А. Рябчикова	Согласовано, 1e8cc3ad-2b4e-43fc-91f9-b97f6b86afb5

РАЗРАБОТАНО:

Старший преподаватель, каф. менеджмента	С.В. Бочанова	Разработано, 5aa11b86-761b-4c0a-8299-5c6566ddeb9d

Согласована на портале № 80557