



**ЧАСТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«СРЕДНЕРУССКИЙ ГУМАНИТАРНО-ТЕХНОЛОГИЧЕСКИЙ ИНСТИТУТ»**

Кафедра экономики и управления

УТВЕРЖДАЮ
Заведующий кафедрой экономики и
управления
Н.М. Ланцова Ланцова Н.М.
«25» августа 2017 года

РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ
РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Укрупненная группа направлений и специальностей	38.00.00 Экономика и управление
Направление	38.03.02 Менеджмент
Профиль	Управление проектом
Форма обучения	заочная

№ п/п	На учебный год	ОДОБРЕНО на заседании кафедры		УТВЕРЖДАЮ заведующий кафедрой	
		Протокол	Дата	Подпись	Дата
1	2017 - 2018	№ 1	«25» августа 2017 г.	<i>Н.М. Ланцова</i>	«25» августа 2017 г.
2	20 - 20	№	« » 20 г.		« » 20 г.
3	20 - 20	№	« » 20 г.		« » 20 г.
4	20 - 20	№	« » 20 г.		« » 20 г.

Обнинск
2017 год

1. ХАРАКТЕРИСТИКА ДИСЦИПЛИНЫ ПО ФГОС ВО

В соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент (уровень бакалавриата) утвержденным приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12 января 2016 г. N 7 дисциплина «Риск-менеджмент» входит в состав вариативной части блока 1 «Дисциплины (модули)». Данная дисциплина, в соответствии с учебным планом института, является обязательной для изучения.

2. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель дисциплины – формирование профессиональной компетенции у будущих управленцев и менеджеров предприятий и финансовых учреждений путем освоения и применения методов риск-менеджмента в сфере экономической и финансовой деятельности.

Задачи курса:

- сформировать знания о методологических основах выявления, классификации рисков при осуществлении предпринимательской деятельности.
- развивать основные навыки, связанные с будущей профессиональной деятельностью: проектировочные, организационные, коммуникативные, информационные и аналитические.
- содействовать осознанию необходимости в приобретении полноценных знаний в области риск-менеджмента путем решения конкретных проектировочных и аналитических задач различными методами.

3. ТРЕБОВАНИЯ К УРОВНЮ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

После изучения дисциплины студенты должны

знать:

- теоретико – методологические основы риск-менеджмента, технологию оценки результата применения различных стратегий, методы оценки уровня риска.

уметь:

- применять методы риск-менеджмента для выбора наилучшей стратегии, самостоятельно провести анализ различных управленческих альтернатив.

владеть:

- представлением о роли и назначении риск-менеджмента при реализации различных управленческих решений в области производства, предпринимательства и операций на финансовых рынках.
- умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании (ПК-15);
- владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов (ПК-16);

4. ТЕМАТИЧЕСКАЯ СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

№ ДЕ	Наименование дидактической единицы	№ п.п.	Тема	Перечень планируемых результатов обучения (ПРО)
1	ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА	1	Введение в риск-менеджмент	ПК-15
		2	Классификация рисков, этапы управления рисками	ПК-15
		3	Организация риск-менеджмента на предприятии.	ПК-15, ПК-16
		4	Особенности выбора стратегии и методы решения управленческих задач Многовариантность риск-менеджмента, эвристические правила риск-менеджмента	ПК-15, ПК-16
2	МОДЕЛИ И МЕТОДЫ РАЗРАБОТКИ РЕШЕНИЙ ПО УПРАВЛЕНИЮ РИСКАМИ В УСЛОВИЯХ КОНКУРЕНЦИИ	5	Определение «функция полезности»	ПК-15
		6	Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»	ПК-15, ПК-16
		7	Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотереи	ПК-16, ПК-15
		8	Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой	ПК-16, ПК-15
		9	Анализ природного риска. Критерий Вальда	ПК-16, ПК-15
		10	Управление рисками на фондовом рынке	ПК-16, ПК-15
3	УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ НА ФИНАНСОВОМ РЫНКЕ	11	Методы управления рисками на фондовом рынке	ПК-16, ПК-15
		12	Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами.	ПК-16, ПК-15
		13	Риски и страхование бизнеса. Особые условия договора.	ПК-16, ПК-15

5. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРНО-ЛОГИЧЕСКОЙ СХЕМЕ

Для изучения дисциплины, необходимы знания и умения из дисциплин, изучаемых ранее по учебному плану. Согласно учебному плану дисциплина «Риск-менеджмент» изучается на четвертом курсе при заочной форме обучения.

Компетенции, знания и умения, приобретаемые студентами после изучения дисциплины будут использоваться ими в ходе осуществления профессиональной деятельности.

6. ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ И ИХ ТРУДОЕМКОСТЬ

Вид учебной работы	Всего часов (Зачетных единиц), 4 курс
1	2
Общая трудоемкость дисциплины	72(2)
Аудиторные занятия*	8
Лекции	4
Лабораторные работы	-
Практические занятия	4
Самостоятельная работа	60
Вид итогового контроля	Зачет (4)

7. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

7.1. СОДЕРЖАНИЕ РАЗДЕЛОВ ДИСЦИПЛИНЫ

Тема 1. Введение в риск-менеджмент

Определение риск-менеджмента, современные подходы к управлению рисками. Примеры «рисковых» и «безрисковых» ситуаций. Факторы неопределенности в современных условиях. Определение «риск-менеджмент».

Тема 2. Классификация рисков, этапы управления рисками

Структурное деление рисков: имущественные, производственные и торговые риски, классификация финансовых рисков.

Основные приемы снижения степени риска (лимитирование, резервирование, хеджирование, страхование и т.д.)

Тема 3. Организация риск-менеджмента на предприятии.

Функции объекта управления и функции субъекта управления, этапы организации риск-менеджмента, функции отдела рискованных вложений капитала.

Тема 4. Особенности выбора стратегии и методы решения управленческих задач

Многовариантность риск-менеджмента, эвристические правила риск-менеджмента на примере управления капиталом.

Тема 5. Определение «функция полезности»

Особенности измерения в риск менеджменте. Особенности введения «функции полезности», математическая запись альтернатив.

Тема 6. Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»

Матричные игры, игры в «чистых стратегиях», антогонистические игры, матрица игры, цели игроков, выбор оптимальной стратегии.

Тема 7. Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотерей.

Условия применения вероятностных моделей в риск-менеджменте. Механизм оценки рисков при проведении лотерей. Применении теории вероятности в риск-менеджменте.

Тема 8. Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой

Банкротство как экономическое явление с позиций риск-менеджмента. Инертность и предсказуемость ситуации банкротства. Теоретические предпосылки прогнозирования банкротства. Z-модели с различным числом факторов, их достоверность.

Тема 9. Анализ природного риска. Критерий Вальда.

Определение «природного риска». Стратегии поведения на неизвестных рынках, поведение предпринимателя, не склонного к риску. Алгоритм выбора наилучшей стратегии на основе наилучшей из наихудших альтернатив (критерий Вальда).

Тема 10. Организация фондового рынка

Особенности организации фондового рынка в Российской Федерации, система бирж в РФ, секции на биржевых площадках. Участники биржевого рынка.

Тема 11. Методы управления рисками на фондовом рынке.

Применение правил риск-менеджмента при совершении сделок на фондовом рынке.

Тема 12. Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами.

Механизм потери инвестиционного счета при совершении сделок с заемным капиталом, правила расчета уровня маржи, законодательные ограничения по совершению маржинальных сделок.

Тема 13. Риски и страхование бизнеса. Особые условия договора.

Страхование как механизм уменьшения риска, факторинг при совершении сделок купли-продажи, валютная, инфляционная оговорка контракта.

7.2. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ РАЗДЕЛОВ ДИСЦИПЛИНЫ ПО ВИДАМ ЗАНЯТИЙ

№ п.п.	Темы дисциплины	Трудоемкость	ЛК	ПЗ	СРС
1	Введение в риск-менеджмент	4,8	0,4	0,4	4
2	Классификация рисков, этапы управления рисками	5,6	0,3	0,3	5
3	Организация риск-менеджмента на предприятии.	5,6	0,3	0,3	5
4	Особенности выбора стратегии и методы решения управленческих задач. Многовариантность риск-менеджмента, эвристические правила риск-менеджмента	5,6	0,3	0,3	5
5	Определение «функция полезности»	5,6	0,3	0,3	5
6	Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»	5,6	0,3	0,3	5
7	Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотереи	5,6	0,3	0,3	5
8	Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой	5,6	0,3	0,3	5
9	Анализ природного риска. Критерий Вальда	5,6	0,3	0,3	5
10	Управление рисками на фондовом рынке	5,6	0,3	0,3	5
11	Методы управления рисками на фондовом рынке	5,6	0,3	0,3	5
12	Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами.	5,6	0,3	0,3	5
13	Риски и страхование бизнеса. Особые условия договора.	5,6	0,3	0,3	5
	Итого:	72	4	4	64

8. ЛАБОРАТОРНЫЕ РАБОТЫ

Учебным планом не предусмотрены

9. ПРАКТИЧЕСКИЕ ЗАНЯТИЯ

Учебным планом предусмотрено проведение практических занятий по дисциплине. Практические занятия предназначены для отработки теоретических положений на практике. Операционно-деятельностная доминанта ПЗ обуславливает необходимость не только вербальных методов обучения, но и деловых и ролевых игр, тренингов, «мозгового штурма» и т. д.

Рекомендуемые темы для проведения практических занятий:

1. Введение в риск-менеджмент
2. Классификация рисков, этапы управления рисками
3. Организация риск-менеджмента на предприятии.
4. Особенности выбора стратегии и методы решения управленческих задач. Многовариантность риск-менеджмента, эвристические правила риск-менеджмента
5. Определение «функция полезности»
6. Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»
7. Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотереи
8. Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой
9. Анализ природного риска. Критерий Вальда
10. Управление рисками на фондовом рынке
11. Методы управления рисками на фондовом рынке
12. Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами.
13. Риски и страхование бизнеса. Особые условия договора.

10. СЕМИНАРСКИЕ ЗАНЯТИЯ

Учебным планом не предусмотрены

11. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

Самостоятельная работа студентов предполагает выбор из предложенного списка источников для изучения и конспектирования, для написания рефератов. Основное назначение данной формы обучения – углубленное самостоятельное ознакомление с альтернативными идеями, теориями, концепциями, технологиями по риск-менеджменту, что позволяет студентам аргументировать свои профессиональные позиции на лекционных и практических занятиях.

11.1. ОБЩИЙ ПЕРЕЧЕНЬ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ

Рекомендуется следующие виды самостоятельной работы:

- выполнение заданий для самостоятельной работы;
- задания для самостоятельной работы;
- написание рефератов;
- заучивание терминологии;
- работа над тестами.

№ п.п.	Темы	Содержание самостоятельной работы	Формы контроля
1	Введение в риск-менеджмент	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
2	Классификация рисков, этапы управления рисками	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
3	Организация риск-менеджмента на предприятии.	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
4	Особенности выбора стратегии и методы решения управленческих задач. Многовариантность риск-менеджмента, эвристические правила риск-менеджмента	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
5	Определение «функция полезности»	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
6	Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
7	Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотереи	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
8	Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
9	Анализ природного риска. Критерий Вальда	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
10	Управление рисками на фондовом рынке	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
11	Методы управления	Написание рефератов, заучивание	Устный опрос,

	рисками на фондовом рынке	терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	проверка тестов, проверка рефератов
12	Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами.	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
13	Риски и страхование бизнеса. Особые условия договора.	Написание рефератов, заучивание терминологии, работа над тестами, выполнение заданий для самостоятельной работы	Устный опрос, проверка тестов, проверка рефератов
	Итого:		

11.2. КУРСОВОЙ ПРОЕКТ

Учебным планом не предусмотрен курсовой проект.

11.3. ПРИМЕРНАЯ ТЕМАТИКА КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ

Учебным планом не предусмотрена.

11.4. ВОПРОСЫ И ЗАДАНИЯ ДЛЯ ЗАЧЕТА

1. Понятие рискованных и безрисковых ситуаций
2. Понятие «риск-менеджмент»
3. Классификация и виды рисков
4. Классификация финансовых рисков
5. Особенности работы риск-менеджера.
6. Основные приемы снижения степени риска
7. Управление финансовыми рисками
8. Функции риск-менеджмента
9. Этапы организации риск-менеджмента
10. Функции отдела рискованных вложений капитала
11. Особенности выбора стратегии и методов решения управленческих задач
12. Эвристические правила риск-менеджмента
13. Понятие «функции полезности»
14. Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»
15. Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотереи
16. Оценка вероятности банкротства (Z-модель).
17. Анализ природного риска. Критерий Вальда
18. Особенности организации фондового рынка в РФ
19. Методы управления рисками на фондовом рынке
20. Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами
21. Роль технического анализа при совершении сделок на фондовом рынке
22. Направления автоматизации риск-менеджмента

11.5. ПРИМЕРЫ ТЕСТОВЫХ ЗАДАНИЙ

1. Задание

Какие дополнительные аспекты бизнеса рассматривает STEEPLED-анализ по сравнению с PESTLE-анализом?

1. Образовательные и демографические
2. Демографические и риски экспорта
3. Образовательные и риски неопределенности
4. Ни один ответ не верен

2. Задание

Каким образом можно организовать исполнение функции риск-менеджмента в соответствии со стандартами FERMA в организации?

1. Сформировать отдельное структурное подразделение
2. Все ответы верны
3. Выделить или набрать специалистов по управлению рисками
4. Пригласить внештатного консультанта

3. Задание

Какова ключевая особенность современного подхода к управлению рисками?

1. Наличие наработок, позволяющих определить возможные риски для каждой из отраслей
2. Использование самых современных и точных математических методов
3. Рассмотрение как позитивных, так и негативных рисков
4. Все ответы верны

4. Задание

Какой в соответствии со стандартом FERMA является вероятность позитивного риска в 50%?

1. Высокой
2. может быть любой в зависимости от выбранной шкалы
3. низкой
4. средней

5. Задание

Какой из методов анализа целесообразно применить для выявления стратегических рисков?

1. HAZOP
2. FTA
3. PESTLE
4. FMEA

6. Задание

Какой из методов анализа целесообразно применить для выявления рисков, связанных с недостатками договорной работы?

1. Анализ сценариев
2. PESTLE-анализ
3. Рассмотрение бизнес-процессов
4. Планирование непрерывности бизнеса

7. Задание

Какой тип рисков невозможно рассчитать статистическими методами?

1. Стратегический

2. Операционный
3. Риск прочих опасностей
4. Финансовый

8. Задание

Что такое оценка рисков?

1. определение приемлемости риска для организации
2. процесс сравнения рассчитанного риска с представленными критериями риска для определения его существенности
3. качественная оценка вероятности его наступления и возможного ущерба
4. процесс присвоения значений вероятности и ущерба

9. Задание

Что является преимуществом экспертных методов расчета рисков по сравнению со статистическими?

1. Возможность расчета финансовых рисков
2. Привлечение квалифицированных экспертов
3. Возможность расчета рисков опасностей
4. Возможность оценки любого риска

12. ФОНДЫ ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

12.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

В результате изучения дисциплины студент должен обладать следующими компетенциями:

- умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании (ПК-15);
- владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов (ПК-16).

После изучения дисциплины студенты должны

знать:

- теоретико – методологические основы риск-менеджмента, технологию оценки результата применения различных стратегий, методы оценки уровня риска.

уметь:

- применять методы риск-менеджмента для выбора наилучшей стратегии, самостоятельно провести анализ различных управленческих альтернатив.

владеть:

- представлением о роли и назначении риск-менеджмента при реализации различных управленческих решений в области производства, предпринимательства и операций на финансовых рынках.

Тематическая структура дисциплины

№ ДЕ	Наименование дидактической единицы ГОС	№ п.п.	Тема	Планируемые результаты обучения (ПРО)
1	ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА	1	Введение в риск-менеджмент	ПК-15
		2	Классификация рисков, этапы управления рисками	ПК-15
		3	Организация риск-менеджмента на предприятии.	ПК-15, ПК-16
		4	Особенности выбора стратегии и методы решения управленческих задач Многовариантность риск-менеджмента, эвристические правила риск-менеджмента	ПК-15, ПК-16
2	МОДЕЛИ И МЕТОДЫ РАЗРАБОТКИ РЕШЕНИЙ ПО УПРАВЛЕНИЮ РИСКАМИ В УСЛОВИЯХ КОНКУРЕНЦИИ	5	Определение «функция полезности»	ПК-15
		6	Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»	ПК-15, ПК-16
		7	Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотереи	ПК-16, ПК-15
		8	Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой	ПК-16, ПК-15
		9	Анализ природного риска. Критерий Вальда	ПК-16, ПК-15
		10	Управление рисками на фондовом рынке	ПК-16, ПК-15
3	УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ НА ФИНАНСОВОМ РЫНКЕ	11	Методы управления рисками на фондовом рынке	ПК-16, ПК-15
		12	Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами.	ПК-16, ПК-15
		13	Риски и страхование бизнеса. Особые условия договора.	ПК-16, ПК-15

Этапы формирования компетенций дисциплины «Риск-менеджмент»

ПК-15 - умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании					
Знать (З.15)		Уметь (У.15)		Владеть (В.15)	
Описание	Формы, методы, технологии	Описание	Формы, методы, технологии	Описание	Формы, методы, технологии
виды управленческих решений и методы их принятия; систему риск-менеджмента проекта, методы анализа, оценки и управления рисками в проекте	Лекции по теме № 1-13 Вопросы для контроля № 1-22 Тестовые задания № 1-9 Темы практических работ 1-13	анализировать внешнюю и внутреннюю среду организации, выявлять ее ключевые элементы и оценивать их влияние на организацию; оценивать риски, доходность и эффективность принимаемых финансовых и инвестиционных решений; принимать оптимальные управленческие решения в условиях неопределенности, экстремальных ситуаций и неплатежеспособности предприятий оценивать риски, доходность и эффективность принимаемых финансовых и инвестиционных решений; определять и проводить количественную и качественную оценки риска проекта, разрабатывать мероприятия по управлению рисками проекта	Лекции по теме № 1-13 Вопросы для контроля № 1-22 Тестовые задания № 1-9 Темы практических работ 1-13	методами формулирования и реализации стратегий на уровне бизнес-единицы; методами управления рисками проекта	Лекции по теме № 1-13 Вопросы для контроля № 1-22 Тестовые задания № 1-9 Темы практических работ 1-13
ПК-16 - владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов					
Знать (З.16)		Уметь (У.16)		Владеть (В.16)	
Описание	Формы, методы, технологии	Описание	Формы, методы, технологии	Описание	Формы, методы, технологии
принципы, способы и методы оценки активов, инвестиционных проектов и организаций; основные схемы и модели финансирования проекта	Лекции по теме № 3,4,6-13 Вопросы для контроля № 11-20 Тестовые задания № 3,4,6-9 Темы практических работ 1-13	оценивать риски, доходность и эффективность принимаемых финансовых и инвестиционных решений; разрабатывать инвестиционные проекты и проводить их оценку;	Лекции по теме № 3,4,6-13 Вопросы для контроля № 11-20 Тестовые задания № 3,4,6-9 Темы практических работ 1-13	методами инвестиционного анализа и анализа финансовых рынков; навыками расчета и анализа основных стоимостных показателей проекта; навыками анализа инновационных процессов и их эффективности	Лекции по теме № 3,4,6-13 Вопросы для контроля № 11-20 Тестовые задания № 3,4,6-9 Темы практических работ 1-13

		анализировать финансовую отчетность по проекту и составлять финансовый план проекта; применять методы финансирования и бюджетирования проекта, разрабатывать схемы финансирования; применять методы финансирования и бюджетирования проекта, разрабатывать схемы финансирования; оценивать финансовую и экономическую эффективность проекта; проводить количественную и качественную оценку эффективности проектной деятельности; оценивать риски, доходность и эффективность принимаемых финансовых и инвестиционных решений			
--	--	---	--	--	--

12.2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания; для каждого результата обучения по дисциплине (модулю) показатели и критерии оценивания сформированности компетенций на различных этапах их формирования, шкалы и процедуры оценивания

12.2.1. Вопросы и задания для зачета и практических занятий

При оценке знаний на зачете учитывается:

1. Уровень сформированности компетенций.
2. Уровень усвоения теоретических положений дисциплины, правильность формулировки основных понятий и закономерностей.
3. Уровень знания фактического материала в объеме программы.
4. Логика, структура и грамотность изложения вопроса.
5. Умение связать теорию с практикой.
6. Умение делать обобщения, выводы.

№ пп	Оценка	Шкала
1	Отлично	Студент должен: - продемонстрировать глубокое и прочное усвоение знаний программного материала; - исчерпывающе, последовательно, грамотно и логически стройно изложить теоретический материал; - правильно формулировать определения; - продемонстрировать умения самостоятельной работы с литературой; - уметь сделать выводы по излагаемому материалу.
2	Хорошо	Студент должен: - продемонстрировать достаточно полное знание программного материала; - продемонстрировать знание основных теоретических понятий; достаточно последовательно, грамотно и логически стройно излагать материал; - продемонстрировать умение ориентироваться в литературе; - уметь сделать достаточно обоснованные выводы по излагаемому материалу.
3	Удовлетворительно	Студент должен: - продемонстрировать общее знание изучаемого материала; - показать общее владение понятийным аппаратом дисциплины; - уметь строить ответ в соответствии со структурой излагаемого вопроса; - знать основную рекомендуемую программой учебную литературу.
4	Неудовлетворительно	Студент демонстрирует: - незнание значительной части программного материала; - не владение понятийным аппаратом дисциплины; - существенные ошибки при изложении учебного материала; - неумение строить ответ в соответствии со структурой излагаемого вопроса;

		- неумение делать выводы по излагаемому материалу.
5	Зачтено	Выставляется при соответствии параметрам экзаменационной шкалы на уровнях «отлично», «хорошо», «удовлетворительно».
6	Незачтено	Выставляется при соответствии параметрам экзаменационной шкалы на уровне «неудовлетворительно».

12.2.2. Тестирование

№ пп	Оценка	Шкала
1	Отлично	Количество верных ответов в интервале: 71-100%
2	Хорошо	Количество верных ответов в интервале: 56-70%
3	Удовлетворительно	Количество верных ответов в интервале: 41-55%
4	Неудовлетворительно	Количество верных ответов в интервале: 0-40%
5	Зачтено	Количество верных ответов в интервале: 41-100%
6	Не зачтено	Количество верных ответов в интервале: 0-40%

12.3. 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

12.3.1 Вопросы и задания для зачета

1. Понятие рискованных и безрисковых ситуаций
2. Понятие «риск-менеджмент»
3. Классификация и виды рисков
4. Классификация финансовых рисков
5. Особенности работы риск-менеджера.
6. Основные приемы снижения степени риска
7. Управление финансовыми рисками
8. Функции риск-менеджмента
9. Этапы организации риск-менеджмента
10. Функции отдела рискованных вложений капитала
11. Особенности выбора стратегии и методов решения управленческих задач
12. Эвристические правила риск-менеджмента
13. Понятие «функции полезности»
14. Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»
15. Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотереи
16. Оценка вероятности банкротства (Z-модель).
17. Анализ природного риска. Критерий Вальда
18. Особенности организации фондового рынка в РФ
19. Методы управления рисками на фондовом рынке
20. Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами
21. Роль технического анализа при совершении сделок на фондовом рынке
22. Направления автоматизации риск-менеджмента

12.3.2. Темы практических занятий

1. Введение в риск-менеджмент
2. Классификация рисков, этапы управления рисками
3. Организация риск-менеджмента на предприятии.
4. Особенности выбора стратегии и методы решения управленческих задач. Многовариантность риск-менеджмента, эвристические правила риск-менеджмента
5. Определение «функция полезности»
6. Методы математического прогнозирования и оценки рисков на основе принципа «опоры на собственные силы»
7. Применение вероятностных моделей оценки риска на примере организации лотереи
8. Модели расчета показателей риска банкротства и невозврата кредита в системе антикризисного управления фирмой
9. Анализ природного риска. Критерий Вальда
10. Управление рисками на фондовом рынке
11. Методы управления рисками на фондовом рынке
12. Оценка риска при проведении сделок с заемными средствами.
13. Риски и страхование бизнеса. Особые условия договора.

12.3.3. Примеры тестовых заданий

1. Задание

Какие дополнительные аспекты бизнеса рассматривает STEEPLED-анализ по сравнению с PESTLE-анализом?

1. Образовательные и демографические
2. Демографические и риски экспорта
3. Образовательные и риски неопределенности
4. Ни один ответ не верен

2. Задание

Каким образом можно организовать исполнение функции риск-менеджмента в соответствии со стандартами FERMA в организации?

1. Сформировать отдельное структурное подразделение
2. Все ответы верны
3. Выделить или набрать специалистов по управлению рисками
4. Пригласить внештатного консультанта

3. Задание

Какова ключевая особенность современного подхода к управлению рисками?

1. Наличие наработок, позволяющих определить возможные риски для каждой из отраслей
2. Использование самых современных и точных математических методов
3. Рассмотрение как позитивных, так и негативных рисков
4. Все ответы верны

4. Задание

Какой в соответствии со стандартом FERMA является вероятность позитивного риска в 50%?

1. Высокой
2. может быть любой в зависимости от выбранной шкалы
3. низкой
4. средней

5. Задание

Какой из методов анализа целесообразно применить для выявления стратегических рисков?

1. HAZOP
2. FTA
3. PESTLE
4. FMEA

6. Задание

Какой из методов анализа целесообразно применить для выявления рисков, связанных с недостатками договорной работы?

1. Анализ сценариев
2. PESTLE-анализ
3. Рассмотрение бизнес-процессов
4. Планирование непрерывности бизнеса

7. Задание

Какой тип рисков невозможно рассчитать статистическими методами?

1. Стратегический
2. Операционный
3. Риск прочих опасностей
4. Финансовый

8. Задание

Что такое оценка рисков?

1. определение приемлемости риска для организации
2. процесс сравнения рассчитанного риска с представленными критериями риска для определения его существенности
3. качественная оценка вероятности его наступления и возможного ущерба
4. процесс присвоения значений вероятности и ущерба

9. Задание

Что является преимуществом экспертных методов расчета рисков по сравнению со статистическими?

1. Возможность расчета финансовых рисков
2. Привлечение квалифицированных экспертов
3. Возможность расчета рисков опасностей
4. Возможность оценки любого риска

12.4.МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И (ИЛИ) ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

Качество знаний характеризуется способностью обучающегося точно, структурированно и уместно воспроизводить информацию, полученную в процессе освоения дисциплины, в том виде, в котором она была изложена в учебном издании или преподавателем.

Умения, как правило, формируются на практических (семинарских) занятиях, а также при выполнении лабораторных работ. Задания, направленные на оценку умений, в значительной степени требуют от студента проявления стереотипности мышления, т.е. способности выполнить работу по образцам, с которыми он работал в процессе обучения. Преподаватель же оценивает своевременность и правильность выполнения задания.

Навыки - это умения, развитые и закрепленные осознанным самостоятельным

трудом. Навыки формируются при самостоятельном выполнении студентом практико - ориентированных заданий, моделирующих решение им производственных и социокультурных задач в соответствующей области профессиональной деятельности, как правило, при выполнении домашних заданий, курсовых проектов (работ), научно-исследовательских работ, прохождении практик, при работе индивидуально или в составе группы на тренажерах, симуляторах, лабораторном оборудовании и т.д. При этом студент поставлен в условия, когда он вынужден самостоятельно (творчески) искать пути и средства для разрешения поставленных задач, самостоятельно планировать свою работу и анализировать ее результаты, принимать определенные решения в рамках своих полномочий, самостоятельно выбирать аргументацию и нести ответственность за проделанную работу, т.е. проявить владение навыками. Взаимодействие с преподавателем осуществляется периодически по завершению определенных этапов работы и проходит в виде консультаций. При оценке владения навыками преподавателем оценивается не только правильность решения выполненного задания, но и способность (готовность) студента решать подобные практико-ориентированные задания самостоятельно (в перспективе за стенами вуза) и, главным образом, способность студента обосновывать и аргументировать свои решения и предложения.

В таблице приведены процедуры оценивания знаний, умений и навыков, характеризующих этапы формирования компетенций.

Виды учебных занятий и контрольных мероприятий	Оцениваемые результаты обучения	Процедуры оценивания
Посещение студентом аудиторных занятий	ЗНАНИЕ теоретического материала по пройденным темам (модулям)	Проверка конспектов лекций, устный опрос на занятиях
Выполнение практических заданий	УМЕНИЯ и НАВЫКИ, соответствующие теме работы	Проверка отчёта, защита выполненной работы
Промежуточная аттестация	ЗНАНИЯ, УМЕНИЯ и НАВЫКИ, соответствующие изученной дисциплине	Зачет

Устный опрос - это процедура, организованная как специальная беседа преподавателя с группой студентов (фронтальный опрос) или с отдельными студентами (индивидуальный опрос) с целью оценки результативности посещения студентами аудиторных занятий путем выяснения сформированности у них основных понятий и усвоения нового учебного материала, который был только что разобран на занятии.

Зачет - процедура оценивания результатов обучения по дисциплинам, результатов прохождения практик, результатов курсового проектирования (выполнения курсовых работ) и т.д., основанная на суммировании баллов, полученных студентом по итогам выполнения им всех видов учебной работы и контрольных мероприятий. Полученная балльная оценка переводится в недифференцированную или дифференцированную оценку.

Вид, место и количество реализуемых по дисциплине процедур оценивания определено в рабочей программе дисциплины и годовых рабочих учебных планах.

Описание показателей, критериев и шкал оценивания по всем видам учебных работ и контрольных мероприятий приведено в разделе 3 фонда оценочных средств по дисциплине.

Разработка оценочных средств и реализация процедур оценивания регламентируются локальными нормативными актами:

– Положение о формировании фонда оценочных средств (принято Ученым советом 28.08.2017 г., Протокол № 1, утверждено ректором Л.А. Косогоровой 28.08.2017 г.)

- Положение о рабочей программе дисциплины (РПД) (принято Ученым советом 28.08.2017 г., Протокол № 1, утверждено ректором Л.А. Косогоровой 28.08.2017 г.)
- Положение о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов (принято Ученым советом 28.08.2017 г., Протокол № 1, утверждено ректором Л.А. Косогоровой 28.08.2017 г.)
- Положение о контактной работе преподавателя с обучающимися (принято Ученым советом 28.08.2017 г., Протокол № 1, утверждено ректором Л.А. Косогоровой 28.08.2017 г.)
- Положение о порядке проведения итоговой аттестации по образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам магистратуры (принято Ученым советом 28.08.2017 г., Протокол № 1, утверждено ректором Л.А. Косогоровой 28.08.2017 г.)
- Инструкция по проведению тестирования (доступны в учебных кабинетах с компьютерной техникой и на сайте вуза).

13. РЕКОМЕНДУЕМОЕ ИНФОРМАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

13.1. НОРМАТИВНОЕ СОПРОВОЖДЕНИЕ

Основой нормативного сопровождения дисциплины являются: ФГОС ВО по направлению 38.03.02 Менеджмент, основная образовательная программа по направлению 38.03.02 Менеджмент, учебный план, рабочая программы дисциплины, курс лекций, методические указания по освоению дисциплины, методические указания для аудиторных занятий.

13.2. ОСНОВНАЯ ЛИТЕРАТУРА

1. Фомичев А.Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров/ Фомичев А.Н.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2016.— 372 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/60617>.— ЭБС «IPRbooks»
2. Балдин К.В. Управление рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012.— 512 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10513>.— ЭБС «IPRbooks»
3. Алексеенко В.Б. Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие/ Алексеенко В.Б., Кутлыева Г.М., Мочалова Ю.И.— Электрон. текстовые данные.— М.: Российский университет дружбы народов, 2013.— 88 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/22224>.— ЭБС «IPRbooks»

13.3. ДОПОЛНИТЕЛЬНАЯ ЛИТЕРАТУРА

1. Балдин К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 418 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/14110>.— ЭБС «IPRbooks»
2. Шапкин А.С. Теория риска и моделирование рисков ситуаций [Электронный ресурс]: учебник/ Шапкин А.С., Шапкин В.А.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 880 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/52275>.— ЭБС «IPRbooks»
3. Иванов А.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Иванов А.А., Олейников С.Я., Бочаров С.А.— Электрон. текстовые данные.— М.: Евразийский открытый институт, 2011.— 304 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10817>.— ЭБС «IPRbooks»
- 4.

13.4. РЕСУРСЫ СЕТИ «ИНТЕРНЕТ»

Электронно-библиотечная система: «IPRbooks»

Ресурсы открытого доступа:

1. Библиотека менеджмента
<http://www.management-rus.ru>
2. Корпоративный менеджмент.
<http://www.cfin.ru>
Новости, публикации, Библиотека управления.
3. Энциклопедия маркетинга. Библиотека маркетолога.
<http://www.marketing.spb.ru>
4. Электронная библиотека HR-специалистов
<http://www.hrm.ru>
Книги по управлению персоналом: статьи по обучению, управлению персоналом, аттестацию и др.
5. Федеральный образовательный портал "Экономика, Социология, Менеджмент"
<http://www.ecsocman.hse.ru>
6. Административно-управленческий портал "Менеджмент и маркетинг в бизнесе".
<http://www.aup.ru>
Книги, статьи, документы по актуальным вопросам менеджмента и маркетинга и пр.
7. Единое окно доступа к образовательным ресурсам по экономике, социологии, менеджменту
<http://ecsocman.edu.ru/>

14. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКАЯ БАЗА

Реализация образовательного процесса по дисциплине «**Экономическая теория**» осуществляется в лекционных аудиториях, аудиториях для семинарских и практических занятий, аудиториях для групповых и индивидуальных консультаций, аудиториях для текущего контроля и промежуточной аттестации.

Для осуществления образовательного процесса по дисциплине необходима следующая материально-техническая база:

1. экран
2. мультимедиа-проектор
3. компьютер
4. телевизор.

15. ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ И ИНФОРМАЦИОННЫХ СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ

Для осуществления образовательного процесса по дисциплине необходимы следующие программное обеспечение и информационные справочные системы:

1. Информационно-правовая система Гарант <http://www.garant.ru/>
2. Справочная правовая система Консультант Плюс <http://www.consultant.ru/>

На рабочих местах используется операционная система Microsoft Windows, пакет Microsoft Office, а также другое специализированное программное обеспечение. В вузе есть два компьютерных класса, оснащенных лицензионным программным обеспечением –

MS office, MS Project, Консультант + агент, 1С 8.2, Visual Studio, Adobe Finereader, Project Expert. Большинство аудиторий оборудовано современной мультимедийной техникой.

Рабочую программу дисциплины разработал: Зырянова О.В., ст. преподаватель