

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РФ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

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



УТВЕРЖДАЮ  
Проректор по учебной работе

Документ подписан электронной подписью

Сертификат: 1сбсfa0a-52a6-4f49-aef0-5584d3fd4820

Владелец: Троян Павел Ефимович

Действителен: с 19.01.2016 по 16.09.2019

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Управление рисками

Уровень образования: **высшее образование - бакалавриат**

Направление подготовки (специальность): **38.03.02 Менеджмент**

Направленность (профиль): **Экономика и управление на предприятии**

Форма обучения: **очная**

Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**

Кафедра: **менеджмента, кафедра менеджмента**

Курс: **4**

Семестр: **8**

Учебный план набора 2016 года

Распределение рабочего времени

№	Виды учебной деятельности	8 семестр	Всего	Единицы
1	Лекции	24	24	часов
2	Практические занятия	24	24	часов
3	Всего аудиторных занятий	48	48	часов
4	Самостоятельная работа	24	24	часов
5	Всего (без экзамена)	72	72	часов
6	Подготовка и сдача экзамена	36	36	часов
7	Общая трудоемкость	108	108	часов
		3.0	3.0	З.Е

Экзамен: 8 семестр

Томск 2017

## ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЙ

Рабочая программа составлена с учетом требований федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки (специальности) 38.03.02 Менеджмент, утвержденного 12 января 2016 года, рассмотрена и утверждена на заседании кафедры « \_\_\_ » \_\_\_\_\_ 20\_\_ года, протокол № \_\_\_\_\_.

Разработчик:

доцент каф. менеджмента \_\_\_\_\_ О. Н. Петухов

Заведующий обеспечивающей каф.  
менеджмента

\_\_\_\_\_ М. А. Афонасова

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

Декан ЭФ \_\_\_\_\_ А. В. Богомолова

Заведующий выпускающей каф.  
менеджмента

\_\_\_\_\_ М. А. Афонасова

Эксперт:

зав. кафедрой, профессор, д.э.н. ка-  
федра менеджмента ЭФ ТУСУР

\_\_\_\_\_ М. А. Афонасова

## 1. Цели и задачи дисциплины

### 1.1. Цели дисциплины

Целями освоения дисциплины являются: формирование у студентов устойчивых знаний о методах оценки, анализа и управления рисками, а также умений и навыков использования этих инструментов в процессе управления организацией.

### 1.2. Задачи дисциплины

- познакомить с основными элементами системы управления финансовыми рисками организации, приемами управления предпринимательскими и финансовыми рисками предприятия и типовыми методами и моделями, используемых в анализе и оптимизации финансовых операций с учетом факторов риска;
- научить использовать в практической деятельности современные специальные экономико-математические инструментарию анализа и оценки риска;
- научить технологии выработки решения в условиях риска и неопределенности и решению типовых задач по управлению финансовыми рисками организации.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Управление рисками» (Б1.В.ОД.7) относится к блоку 1 (вариативная часть).

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

## 3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

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

В результате изучения дисциплины студент должен:

- **знать** содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методологию процесса управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками.

- **уметь** применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками; классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления; проводить выбор между способами передачи рисков, осуществлять соответствующие расчеты к ним; оценивать результативность принятых управленческих решений; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач анализа и оценки рисков. использовать математические и статистические методы расчета уровня рисков, определять привлекательность инвестиционного портфеля, пользоваться инструментами риск-менеджмента.

- **владеть** методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения поручений.

## 4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3.0 зачетных единицы и представлена в таблице 4.1.

Таблица 4.1 – Трудоемкость дисциплины

Виды учебной деятельности	Всего часов	Семестры
		8 семестр
Аудиторные занятия (всего)	48	48

Лекции	24	24
Практические занятия	24	24
Самостоятельная работа (всего)	24	24
Проработка лекционного материала	8	8
Подготовка к практическим занятиям, семинарам	8	8
Подготовка и написание отчета по практике	8	8
Всего (без экзамена)	72	72
Подготовка и сдача экзамена	36	36
Общая трудоемкость ч	108	108
Зачетные Единицы	3.0	3.0

## 5. Содержание дисциплины

### 5.1. Разделы дисциплины и виды занятий

Разделы дисциплины и виды занятий приведены в таблице 5.1.

Таблица 5.1 – Разделы дисциплины и виды занятий

Названия разделов дисциплины	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	Всего часов (без экзамена)	Формируемые компетенции
8 семестр					
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	12	12	12	36	ПК-4
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	12	12	12	36	ПК-4
Итого за семестр	24	24	24	72	
Итого	24	24	24	72	

### 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
8 семестр			
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Понятие и сущность риска. Определение, функции, организация и правила управление рисками. Информационное обеспечение управления рисками. - Классификация рисков. Анализ и оцен-	12	ПК-4

	ка степени риска.		
	Итого	12	
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Управление рисками, возникающими при инвестировании. Риск-менеджмент. Хеджирование рисков. Анализ риска в инвестиционной программе. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Рациональный выбор инвестиционного портфеля.	12	ПК-4
	Итого	12	
Итого за семестр		24	

### 5.3. Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами

Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами представлены в таблице 5.3.

Таблица 5.3 - Разделы дисциплины и междисциплинарные связи

Наименование дисциплин	№ разделов данной дисциплины, для которых необходимо изучение обеспечивающих и обеспечиваемых дисциплин	
	1	2
Предшествующие дисциплины		
1 Финансовый менеджмент	+	+
2 Финансы предприятий	+	+
3 Экономика предприятия	+	+
4 Экономический анализ	+	+

### 5.4. Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий представлено в таблице 5.4

Таблица 5.4 – Соответствие компетенций и видов занятий, формируемых при изучении дисциплины

Компетенции	Виды занятий			Формы контроля
	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	
ПК-4	+	+	+	Собеседование, Опрос на занятиях, Выступление (доклад) на занятии, Отчет по практическому занятию

## 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
8 семестр			
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Оценка риска проекта на основе анализа безубыточности. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределённости и риска минимаксными методами.	12	ПК-4
	Итого	12	
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов. Страхование как метод снижения рисков. Хеджирование как метод снижения риска.	12	ПК-4
	Итого	12	
Итого за семестр		24	

## 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
8 семестр				
1 Теоретико-методологические основы системы управления рисками проектов	Подготовка и написание отчета по практике	4	ПК-4	Опрос на занятиях, Отчет по практическому занятию
	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	4		
	Проработка лекционного материала	4		
	Итого	12		
2 Модели и методы	Подготовка и написание	4	ПК-4	Опрос на занятиях, От-

разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	отчета по практике		чет по практическому занятию
	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	4	
	Проработка лекционного материала	4	
	Итого	12	
Итого за семестр		24	
	Подготовка и сдача экзамена	36	Экзамен
Итого		60	

### 10. Курсовая работа (проект)

Не предусмотрено РУП

### 11. Рейтинговая система для оценки успеваемости студентов

#### 11.1. Балльные оценки для элементов контроля

Таблица 11.1 – Балльные оценки для элементов контроля

Элементы учебной деятельности	Максимальный балл на 1-ую КТ с начала семестра	Максимальный балл за период между 1КТ и 2КТ	Максимальный балл за период между 2КТ и на конец семестра	Всего за семестр
8 семестр				
Выступление (доклад) на занятии	6	6	5	17
Опрос на занятиях	6	6	5	17
Отчет по практическому занятию	6	6	6	18
Собеседование	6	6	6	18
Итого максимум за период	24	24	22	70
Экзамен				30
Нарастающим итогом	24	48	70	100

#### 11.2. Пересчет баллов в оценки за контрольные точки

Пересчет баллов в оценки за контрольные точки представлен в таблице 11.2.

Таблица 11. 2 – Пересчет баллов в оценки за контрольные точки

Баллы на дату контрольной точки	Оценка
≥ 90% от максимальной суммы баллов на дату КТ	5
От 70% до 89% от максимальной суммы баллов на дату КТ	4
От 60% до 69% от максимальной суммы баллов на дату КТ	3
< 60% от максимальной суммы баллов на дату КТ	2

#### 11.3. Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку представлен в таблице 11.3.

Таблица 11. 3 – Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

Оценка (ГОС)	Итоговая сумма баллов, учитывает успешно сданный экзамен	Оценка (ECTS)
5 (отлично) (зачтено)	90 - 100	A (отлично)
4 (хорошо) (зачтено)	85 - 89	B (очень хорошо)
	75 - 84	C (хорошо)
	70 - 74	D (удовлетворительно)
65 - 69		
3 (удовлетворительно) (зачтено)	60 - 64	E (посредственно)
	Ниже 60 баллов	F (неудовлетворительно)

## 12. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### 12.1. Основная литература

1. Управление рисками проектов: Учебное пособие / Кулешова Е. В. - 2015. 188 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: <https://edu.tusur.ru/publications/4956>, дата обращения: 20.05.2017.

### 12.2. Дополнительная литература

1. Анализ и управление рисками организации : учебное пособие для вузов / Н. А. Рыртикова. - М. : Форум, 2009. - 239 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)

2. Основы проектной деятельности: Учебное пособие / Алферова Л. А. - 2017. 111 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: <https://edu.tusur.ru/publications/6932>, дата обращения: 20.05.2017.

### 12.3 Учебно-методические пособия

#### 12.3.1. Обязательные учебно-методические пособия

1. Управление рисками: Методические указания к лабораторным, практическим занятиям и самостоятельной работе для студентов направления 080100.62 – «Экономика», профиль - «Финансы и кредит» / Кулешова Е. В. - 2014. 38 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: <https://edu.tusur.ru/publications/4890>, дата обращения: 20.05.2017.

#### 12.3.2 Учебно-методические пособия для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Учебно-методические материалы для самостоятельной и аудиторной работы обучающихся из числа инвалидов предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации.

##### Для лиц с нарушениями зрения:

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

##### Для лиц с нарушениями слуха:

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

##### Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

### 12.4. Базы данных, информационно-справочные, поисковые системы и требуемое программное обеспечение

1. Научная электронная библиотека <http://elibrary.ru>
2. Российская государственная библиотека <http://www.rsl.ru>
3. Российская национальная библиотека <http://www.nlr.ru>
4. Электронные книги <http://books.mlmbiz.ru>
5. Публичная Интернет-библиотека <http://www.public.ru>



6. Библиотека экономики <http://www.finansy.ru/publ.htm>

### **13. Материально-техническое обеспечение дисциплины**

#### **13.1. Общие требования к материально-техническому обеспечению дисциплины**

##### **13.1.1. Материально-техническое обеспечение для лекционных занятий**

Для проведения занятий лекционного типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации используется учебная аудитория, с количеством посадочных мест не менее 22-24, оборудованная доской и стандартной учебной мебелью. Имеются наглядные пособия в виде презентаций по лекционным разделам дисциплины.

##### **13.1.2. Материально-техническое обеспечение для практических занятий**

Для проведения практических (семинарских) занятий используется учебная аудитория, расположенная по адресу 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 74, 4 этаж, ауд. XXX. Состав оборудования: Учебная мебель; Доска магнитно-маркерная -1шт.; Коммутатор D-Link Switch 24 port - 1шт.; Компьютеры класса не ниже ПЭВМ INTEL Celeron D336 2.8ГГц. -14 шт. Используется лицензионное программное обеспечение, пакеты версией не ниже: Microsoft Windows XP Professional with SP3/Microsoft Windows 7 Professional with SP1; Microsoft Windows Server 2008 R2; Visual Studio 2008 EE with SP1; Microsoft Office Visio 2010; Microsoft Office Access 2003; VirtualBox 6.2. Имеется помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования.

##### **13.1.3. Материально-техническое обеспечение для самостоятельной работы**

Для самостоятельной работы используется учебная аудитория (компьютерный класс), расположенная по адресу 634034, г. Томск, ул. Красноармейская, 146, 2 этаж, ауд. 204. Состав оборудования: учебная мебель; компьютеры класса не ниже ПЭВМ INTEL Celeron D336 2.8ГГц. - 7 шт.; компьютеры подключены к сети ИНТЕРНЕТ и обеспечивают доступ в электронную информационно-образовательную среду университета.

#### **13.2. Материально-техническое обеспечение дисциплины для лиц с ограниченными возможностями здоровья**

Освоение дисциплины лицами с ОВЗ осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения.

При обучении студентов **с нарушениями слуха** предусмотрено использование звукоусиливающей аппаратуры, мультимедийных средств и других технических средств приема/передачи учебной информации в доступных формах для студентов с нарушениями слуха, мобильной системы обучения для студентов с инвалидностью, портативной индукционной системы. Учебная аудитория, в которой обучаются студенты с нарушением слуха, оборудована компьютерной техникой, аудиотехникой, видеотехникой, электронной доской, мультимедийной системой.

При обучении студентов **с нарушениями зрениями** предусмотрено использование в лекционных и учебных аудиториях возможности просмотра удаленных объектов (например, текста на доске или слайда на экране) при помощи видеоувеличителей для удаленного просмотра.

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

### **14. Фонд оценочных средств**

#### **14.1. Основные требования к фонду оценочных средств и методические рекомендации**

Фонд оценочных средств и типовые контрольные задания, используемые для оценки сформированности и освоения закрепленных за дисциплиной компетенций при проведении текущей, промежуточной аттестации по дисциплине приведен в приложении к рабочей программе.

Управление рисками: Методические указания к лабораторным, практическим занятиям и самостоятельной работе для студентов направления 080100.62 – «Экономика», профиль - «Финансы и кредит» / Кулешова Е. В. – 2014. 38 с. <http://edu.tusur.ru/training/publications/4890>

## 14.2 Требования к фонду оценочных средств для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Для студентов с инвалидностью предусмотрены дополнительные оценочные средства, перечень которых указан в таблице.

**Таблица 14 – Дополнительные средства оценивания для студентов с инвалидностью**

Категории студентов	Виды дополнительных оценочных средств	Формы контроля и оценки результатов обучения
С нарушениями слуха	Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы	Преимущественно письменная проверка
С нарушениями зрения	Собеседование по вопросам к зачету, опрос по терминам	Преимущественно устная проверка (индивидуально)
С нарушениями опорно-двигательного аппарата	Решение дистанционных тестов, контрольные работы, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету	Преимущественно дистанционными методами
С ограничениями по общемедицинским показаниям	Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы, устные ответы	Преимущественно проверка методами, исходя из состояния обучающегося на момент проверки

## 14.3 Методические рекомендации по оценочным средствам для лиц с ограниченными возможностями здоровья

Для студентов с ОВЗ предусматривается доступная форма предоставления заданий оценочных средств, а именно:

- в печатной форме;
- в печатной форме с увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа;
- методом чтения ассистентом задания вслух;
- предоставление задания с использованием сурдоперевода.

Студентам с инвалидностью увеличивается время на подготовку ответов на контрольные вопросы. Для таких студентов предусматривается доступная форма предоставления ответов на задания, а именно:

- письменно на бумаге;
- набор ответов на компьютере;
- набор ответов с использованием услуг ассистента;
- представление ответов устно.

Процедура оценивания результатов обучения инвалидов по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

**Для лиц с нарушениями зрения:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

**Для лиц с нарушениями слуха:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

**Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

При необходимости для обучающихся с инвалидностью процедура оценивания результатов обучения может проводиться в несколько этапов.

**МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РФ**

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования**

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

УТВЕРЖДАЮ  
Проректор по учебной работе  
\_\_\_\_\_ П. Е. Троян  
«\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ**

**Управление рисками**

Уровень образования: **высшее образование - бакалавриат**

Направление подготовки (специальность): **38.03.02 Менеджмент**

Направленность (профиль): **Экономика и управление на предприятии**

Форма обучения: **очная**

Факультет: **ЭФ, Экономический факультет**

Кафедра: **менеджмента, кафедра менеджмента**

Курс: **4**

Семестр: **8**

Учебный план набора 2016 года

Разработчик:

– доцент каф. менеджмента О. Н. Петухов

Экзамен: 8 семестр

Томск 2017

## 1. Введение

Фонд оценочных средств (ФОС) является приложением к рабочей программе дисциплины (практики) и представляет собой совокупность контрольно-измерительных материалов (типовые задачи (задания), контрольные работы, тесты и др.) и методов их использования, предназначенных для измерения уровня достижения студентом установленных результатов обучения.

ФОС по дисциплине (практике) используется при проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации студентов.

Перечень закрепленных за дисциплиной (практикой) компетенций приведен в таблице 1.

Таблица 1 – Перечень закрепленных за дисциплиной компетенций

Код	Формулировка компетенции	Этапы формирования компетенций
ПК-4	умением применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации	<p>Должен знать содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методологию процесса управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками. ;</p> <p>Должен уметь применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками; классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления; проводить выбор между способами передачи рисков, осуществлять соответствующие расчеты к ним; оценивать результативность принятых управленческих решений; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач анализа и оценки рисков. использовать математические и статистические методы расчета уровня рисков, определять привлекательность инвестиционного портфеля, пользоваться инструментами риск-менеджмента. ;</p> <p>Должен владеть методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения поручений. ;</p>

Общие характеристики показателей и критериев оценивания компетенций на всех этапах приведены в таблице 2.

Таблица 2 – Общие характеристики показателей и критериев оценивания компетенций по этапам

Показатели и	Знать	Уметь	Владеть
--------------	-------	-------	---------

критерии			
Отлично (высокий уровень)	Обладает фактическими и теоретическими знаниями в пределах изучаемой области с пониманием границ применимости	Обладает диапазоном практических умений, требуемых для развития творческих решений, абстрагирования проблем	Контролирует работу, проводит оценку, совершенствует действия работы
Хорошо (базовый уровень)	Знает факты, принципы, процессы, общие понятия в пределах изучаемой области	Обладает диапазоном практических умений, требуемых для решения определенных проблем в области исследования	Берет ответственность за завершение задач в исследовании, приспосабливает свое поведение к обстоятельствам в решении проблем
Удовлетворительно (пороговый уровень)	Обладает базовыми общими знаниями	Обладает основными умениями, требуемыми для выполнения простых задач	Работает при прямом наблюдении

## 2 Реализация компетенций

### 2.1 Компетенция ПК-4

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

Для формирования компетенции необходимо осуществить ряд этапов. Этапы формирования компетенции, применяемые для этого виды занятий и используемые средства оценивания представлены в таблице 3.

Таблица 3 – Этапы формирования компетенции и используемые средства оценивания

Состав	Знать	Уметь	Владеть
Содержание этапов	содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методологию процесса управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками.	применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками; классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления; проводить выбор между способами передачи рисков, осуществлять соответствующие расчеты к ним; оценивать результативность принятых управленческих решений; выбирать подходящий математический инструментарий для решения задач анализа и оценки рисков. использовать математические и статистические методы расчета уровня рисков,	методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения поручений.

		определять привлекательность инвестиционного портфеля, пользоваться инструментами риск-менджмента.	
Виды занятий	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Практические занятия;</li> <li>• Лекции;</li> <li>• Самостоятельная работа;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Практические занятия;</li> <li>• Лекции;</li> <li>• Самостоятельная работа;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Самостоятельная работа;</li> </ul>
Используемые средства оценивания	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Собеседование;</li> <li>• Опрос на занятиях;</li> <li>• Выступление (доклад) на занятии;</li> <li>• Отчет по практическому занятию;</li> <li>• Экзамен;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Собеседование;</li> <li>• Опрос на занятиях;</li> <li>• Выступление (доклад) на занятии;</li> <li>• Отчет по практическому занятию;</li> <li>• Экзамен;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Выступление (доклад) на занятии;</li> <li>• Отчет по практическому занятию;</li> <li>• Экзамен;</li> </ul>

Формулировка показателей и критериев оценивания данной компетенции приведена в таблице 4.

Таблица 4 – Показатели и критерии оценивания компетенции на этапах

Состав	Знать	Уметь	Владеть
Отлично (высокий уровень)	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Имеет сформированные и систематические знания о базовых моделях и принципах принятия решений по управлению рисками. Имеет хорошее представление о методологических основах оценки, методах оценки рисков, особенностях оценки рисков для конкретных целей;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Показывает успешное и систематическое умение свободно справляться с решением оценочных задач, аргументировано и корректно выполнять устные и письменные задания по управлению рисками. Использует в ответе материал специальной литературы, правильно обосновывает принятые решения ;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Демонстрирует успешное владение навыками и приемами выполнения практических задач по управлению рисками. Свободно владеет разными способами представления и использования оценочной информацией рисков для целей управления организацией.;</li> </ul>
Хорошо (базовый уровень)	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Твердо знает сущность о базовых моделях и принципах принятия решений по управлению рисками, грамотно и по существу излагает материал дисциплины, не допуская существенных неточностей в ответе на вопросы;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Показывает в целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение аргументировано и корректно выполнять устные и письменные задания по управлению рисками. Правильно применяет теоретические положения при решении практических задач. ;</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Способен в достаточной степени логично и аргументировано изложить результаты своих исследований по управлению рисками, как в устной, так и в письменной форме. Владеет необходимыми навыками и приемами по управлению рисками. ;</li> </ul>
Удовлетворительно (пороговый уровень)	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Знает содержание отдельных направлений о базовых моделях и принципах принятия</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Показывает неполное, недостаточное сформированное умение проводить оценку</li> </ul>	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Демонстрирует неполное, недостаточное владение навыками по управлению рисками,</li> </ul>

	<p>решений по управлению рисками, имеет представление о методологических основах оценки рисков, методах оценки рисков, особенностях оценки рисков для конкретных целей. Дает определения основных понятий.;</p>	<p>рисков. Умеет работать со справочной литературой. Умеет представлять результаты своей работы Показывает неполное, недостаточное сформированное умение проводить оценку рисков. Умеет работать со справочной литературой. Умеет представлять результаты своей работы ;</p>	<p>методами решения оценочных задач по рискам. Способен корректно и понятно изложить свои представления в устной и письменной формах. ;</p>
--	---	--	---

### 3 Типовые контрольные задания

Для реализации вышеперечисленных задач обучения используются типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы, в следующем составе.

#### 3.1 Вопросы на собеседование

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

#### 3.2 Темы опросов на занятиях

- Понятие и сущность риска.
- Определение, функции, организация и правила управление рисками.
- Информационное обеспечение управления рисками.
- Классификация рисков.
- Анализ и оценка степени риска.
- Управление рисками, возникающими при инвестировании.
- Риск-менеджмент.
- Хеджирование рисков.
- Анализ риска в инвестиционной программе.
- Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций.
- Рациональный выбор инвестиционного портфеля.

#### 3.3 Темы докладов

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

#### 3.4 Экзаменационные вопросы

- 1. Основные определения риска.
- 2. Дать основную характеристику задач системы управления риском.
- 3. Классификация рисков.
- 4. Критерии классификации по характеристике взаимодействия с другими рисками.
- 5. Система управления риском.
- 6. Цели и задачи управления риском.
- 7. Этапы управления риском.
- 8. Общая характеристика идентификации и анализа рисков.
- 9. Основные принципы оценки риска.
- 10. Методы управления риском.
- 11. Методы финансирования рисков.

- 12. Руководство по разработке, контролю и пересмотру программ управления рисками.
- 13. Процедуры разработки, контроля и пересмотра программ управления рисками.
- 14. Критерии классификации по характеристике расходов, связанных с рисками.
- 15. Классификация по величине риска.
- 16. Управление рисками от актов незаконного вмешательства в деятельность конкретной организации.
- 17. Критерии классификации по характеристике подверженности риску.
- 18. Программа управления рисками
- 19. Критерии классификации по характеристике опасности.
- 20. Программа управления рисками.

### **3.5 Вопросы для подготовки к практическим занятиям, семинарам**

- Оценка риска проекта на основе анализа безубыточности.
- Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределённости и риска минимаксными методами.
- Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов.
- Страхование как метод снижения рисков.
- Хеджирование как метод снижения риска.

## **4 Методические материалы**

Для обеспечения процесса обучения и решения задач обучения используются следующие материалы:

- методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, согласно п. 12 рабочей программы.

### **4.1. Основная литература**

1. Управление рисками проектов: Учебное пособие / Кулешова Е. В. - 2015. 188 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: <https://edu.tusur.ru/publications/4956>, свободный.

### **4.2. Дополнительная литература**

1. Анализ и управление рисками организации : учебное пособие для вузов / Н. А. Рыхтикова. - М. : Форум, 2009. - 239 с. (наличие в библиотеке ТУСУР - 9 экз.)
2. Основы проектной деятельности: Учебное пособие / Алферова Л. А. - 2017. 111 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: <https://edu.tusur.ru/publications/6932>, свободный.

### **4.3. Обязательные учебно-методические пособия**

1. Управление рисками: Методические указания к лабораторным, практическим занятиям и самостоятельной работе для студентов направления 080100.62 – «Экономика», профиль - «Финансы и кредит» / Кулешова Е. В. - 2014. 38 с. [Электронный ресурс] - Режим доступа: <https://edu.tusur.ru/publications/4890>, свободный.

### **4.4. Базы данных, информационно справочные и поисковые системы**

1. Научная электронная библиотека <http://elibrary.ru>
2. Российская государственная библиотека <http://www.rsl.ru>
3. Российская национальная библиотека <http://www.nlr.ru>
4. Электронные книги <http://books.mlmbiz.ru>
5. Публичная Интернет-библиотека <http://www.public.ru>
6. Библиотека экономики <http://www.finansy.ru/publ.htm>