## МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РФ

# Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

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

		УТВЕРЖДАЮ		
Пр	орек	стор по учебной ра	або	те
		П. Е. Т	po.	ЯН
<b>‹</b> ‹	<b>&gt;&gt;</b>	20	0	Γ

# 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 2017 года

# Распределение рабочего времени

No	Виды учебной деятельности	8 семестр	Всего	Единицы
1	Лекции	20	20	часов
2	Практические занятия	20	20	часов
3	Всего аудиторных занятий	40	40	часов
4	Самостоятельная работа	68	68	часов
5	Всего (без экзамена)	108	108	часов
6	Общая трудоемкость	108	108	часов
		3.0	3.0	3.E

Дифференцированный зачет: 8 семестр

Томск 2017

Рассмотрена и	од	обрена на	заседании	кафедры
протокол №	9	от « <u>12</u>	» <u>4</u>	20 <u>17</u> г.

# ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЙ

вательного стандарта высшего образования (Ф	требований федерального государственного образо- ГОС ВО) по направлению подготовки (специально- нваря 2016 года, рассмотрена и утверждена на засе- протокол №
Разработчик:	
доцент каф. менеджмента	О. Н. Петухов
Заведующий обеспечивающей каф. менеджмента	М. А. Афонасова
Рабочая программа согласована с факули направления подготовки (специальности).	тетом, профилирующей и выпускающей кафедрами
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 инструментарии 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, 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-менджмента.
- 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)	40	40
Лекции	20	20

Практические занятия	20	20
Самостоятельная работа (всего)	68	68
Проработка лекционного материала	24	24
Подготовка к практическим занятиям, семинарам	24	24
Подготовка и написание отчета по практике	20	20
Всего (без экзамена)	108	108
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	10	10	34	54	ПК-4
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	10	10	34	54	ПК-4
Итого за семестр	20	20	68	108	
Итого	20	20	68	108	

# 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 оценка степени риска.	10	ПК-4			
	Итого	10				

2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы рискменеджмента	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.	10	ПК-4
	Итого	10	
Итого за семестр		20	

# 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 которы необходимо изучение обеспечивающих и обеспечиваемых дисципли				
Предшествующие дисциплины					
1 Финансовый менеджмент	+	+			
2 Экономика предприятия	+	+			
3 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

НЫ		D×		
	Виды занятий			
Компетенции	Лекции	Практические занятия	Самостоятельная работа	Формы контроля
ПК-4	+	+	+	Опрос на занятиях, 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.	10	ПК-4
	Итого	10	
2 Модели и методы разработки решений по управлению рисками и организации системы рискменеджмента	Оценка эффективности проекта в условиях риска (оценка риска) с использованием статистических методов.Страхование как метод снижения рисков.Хеджирование как метод снижения риска.	10	ПК-4
	Итого	10	
Итого за семестр		20	

# 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

таолица 9.1 - Виды самостоятельной расоты, трудоемкость и формируемые компетенции				
Названия разделов	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции	Формы контроля
	8 семест	p		
1 Теоретико- методологические	Подготовка и написание отчета по практике	10	ПК-4	Опрос на занятиях, Отчет по практическому за-
основы системы управления рисками проектов	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	12		нятию
	Проработка лекционного материала	12		
	Итого	34		
2 Модели и методы разработки решений по	Подготовка и написание отчета по практике	10	ПК-4	Опрос на занятиях, Отчет по практическому за-
управлению рисками и организации системы риск-менеджмента	Подготовка к практиче- ским занятиям, семина- рам	12	онткн	нятию
	Проработка лекционного материала	12		

	Итого	34	
Итого за семестр		68	
Итого		68	

# 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		
Опрос на занятиях	20	15	15	50
Отчет по практическому занятию	20	15	15	50
Итого максимум за период	40	30	30	100
Нарастающим итогом	40	70	100	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	А (отлично)
	85 - 89	В (очень хорошо)
4 (хорошо) (зачтено)	75 - 84	С (хорошо)
	70 - 74	D ()
2 ()	65 - 69	D (удовлетворительно)
3 (удовлетворительно) (зачтено)	60 - 64	Е (посредственно)
2 (неудовлетворительно) (не зачтено)	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. 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, 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 Ce1егоп 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

Tuotingu II Agnotini Ittisiisio opentusu agunisuum Atin tijaani os timisuuman otisio				
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	Решение дистанционных тестов, контрольные работы, письменные самостоятельные работы, вопросы к	Преимущественно дистанционными методами		

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

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

Для студентов с OB3 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)

	7	УТВЕРЖДАЮ		
Пр	орект	гор по учебной ра	або	те
		П. Е. Т	po.	ян
<b>‹</b> ‹	<b>&gt;&gt;</b>	2	0	Γ

# 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 2017 года

Разработчик:

- доцент каф. менеджмента О. Н. Петухов

Дифференцированный зачет: 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 – Перецени закреплении у за лисимплицой компетенций

Таблица 1 -	а 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	Должен знать содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками.; 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, определять привлекательность инвестиционного портфеля, пользоваться инструментами рискменджмента.; Должен владеть методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения поручений.;			

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, совер- шенствует действия ра- боты
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 ис- следовании, приспосаб- ливает свое поведение к обстоятельствам в реше- нии проблем
Удовлетворительно (пороговый уровень)	Обладает базовыми об- щими знаниями	Обладает основными умениями, требуемыми для выполнения простых задач	Работает при прямом на- блюдении

### 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 эта-	содержание, цели, зада-	применять аналитиче-	методологией экономи-
ПОВ	чи и принципы разра-	ские приемы определе-	ческого исследования;
	ботки системы управле-	ния целесообразности	современными методами
	ния рисками организа-	принятия решений в об-	сбора, обработки и ана-
	ции; инструменты и ме-	ласти управления риска-	лиза экономических и
	тоды управления риска-	ми; классифицировать	социальных данных; ме-
	ми; общую терминоло-	риски, выявлять особен-	тодами и приемами ана-
	гию в области управле-	ности их возникновения	лиза экономических яв-
	ния рисками; методоло-	и управления; прово-	лений и процессов с по-
	гию процесса управле-	дить выбор между	мощью стандартных тео-
	ния рисками; методы	способами передачи рис-	ретических и экономет-
	выявления, оценки и ана-	ков, осуществлять соот-	рических моделей;
	лиза уровня рисков,	ветствующие расчеты к	современными методика-
	управления рисками.	ним; оценивать ре-	ми расчета и анализа по-
		зультативность приня-	казателей риска; навыка-
		тых управленческих ре-	ми самостоятельной ра-
		шений; выбирать подхо-	боты, самоорганизации и
		дящий математический	организации выполнения
		инструментарий для ре-	поручений.
		шения задач анализа и	
		оценки рисков. исполь-	
		зовать математические и	
		статистические методы	
		расчета уровня рисков,	

		определять привлека- тельность инвестици- онного портфеля, поль- зоваться инструментами риск-менджмента.	
Виды занятий	<ul><li>Практические занятия;</li><li>Лекции;</li><li>Самостоятельная работа;</li></ul>	<ul> <li>Практические занятия;</li> <li>Лекции;</li> <li>Самостоятельная работа;</li> </ul>	• Самостоятельная работа;
Используемые средства оценивания	<ul> <li>Опрос на занятиях;</li> <li>Отчет по практическому занятию;</li> <li>Дифференцированный зачет;</li> </ul>	<ul> <li>Опрос на занятиях;</li> <li>Отчет по практическому занятию;</li> <li>Дифференцированный зачет;</li> </ul>	<ul><li>Отчет по практическому занятию;</li><li>Дифференцированный зачет;</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)	• 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;	• 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;	• 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.;
Хорошо (базовый уровень)	• Твердо знает сущ- ность о базовых моде- лях и принципах приня- тия решений по управ- лению рисками, грамот- но и по существу изла- гает материал дисци- плины, не допуская су- щественных неточно- стей в ответе на вопро- сы;	• 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.;	• 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.;
Удовлетворительн о (пороговый уровень)	• Знает содержание отдельных направлений о базовых моделях и принципах принятия решений по управлению рисками, имеет	• Показывает неполное, недостаточное сформированное умение проводить оценку рисков. Умеет работать со справочной литера-	• Демонстрирует неполное, недостаточное владение навыками по управлению рисками, методами решения оценочных задач по рис-

представление о мето-	турой. Умеет представ-	кам. Способен коррект-
дологических основах	лять результаты своей	но и понятно изложить
оценки рисков, методах	работы Показывает не-	свои представления в
оценки рисков, особен-	полное, недостаточное	устной и письменной
ностях оценки рисков	сформированное уме-	формах.;
для конкретных целей.	ние проводить оценку	
Дает определения	рисков. Умеет работать	
основных понятий.;	со справочной литера-	
	турой. Умеет представ-	
	лять результаты своей	
	работы ;	

### 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 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.

### 3.2 Вопросы для подготовки к практическим занятиям, семинарам

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

## 3.3 Вопросы дифференцированного зачета

1. Основные определения риска. 2. Дать основную характеристику задач системы управления риском. 3. Классификация риском. 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.

### 4 Методические материалы

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

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

### 4.1. Основная литература

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

# 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