

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
 федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования  
**«САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ  
 ПРОМЫШЛЕННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ И ДИЗАЙНА»**

УТВЕРЖДАЮ  
 Первый проректор, проректор по учебной  
 работе

\_\_\_\_\_ А.Е. Рудин  
 «30» июня 2020 г.

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

**Б1.В.ДВ.07.02**

(Индекс дисциплины)

**Управление экономическими и производственными рисками**

(Наименование дисциплины)

Кафедра: **2** Полиграфического оборудования и управления

Направление подготовки: **38.03.02 - Менеджмент**

Профиль подготовки: **Менеджмент в медиабизнесе и полиграфии**

Уровень образования: **Бакалавриат**

### План учебного процесса

Составляющие учебного процесса		Очное обучение	Очно-заочное обучение	Заочное обучение
Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий и самостоятельная работа обучающихся (часы)	Всего	<b>180</b>		<b>180</b>
	Аудиторные занятия	<b>51</b>		<b>12</b>
	Лекции	17		8
	Лабораторные занятия	-		-
	Практические занятия	34		4
	Самостоятельная работа	129		164
	Промежуточная аттестация	-		<b>4</b>
Формы контроля по семестрам (номер семестра)	Экзамен	-		-
	Зачет с оценкой	6		7
	Контрольная работа			7
	Курсовой проект (работа)	-		-
<b>Общая трудоемкость дисциплины (зачетные единицы)</b>		<b>5</b>		<b>5</b>

Форма обучения:	Распределение зачетных единиц трудоемкости по семестрам											
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Очная						<b>5</b>						
Очно-заочная												
Заочная						<b>0,5</b>	<b>4,5</b>					

Рабочая программа составлена в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по соответствующему направлению подготовки

и на основании учебного плана № 1/1/794, 1/3/795

# 1. ВВЕДЕНИЕ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

## 1.1. Место преподаваемой дисциплины в структуре образовательной программы

Блок 1: Базовая  Обязательная  Дополнительно является факультативом   
Вариативная  По выбору

## 1.2. Цель дисциплины

Сформировать компетенции обучающегося в области изучения теории и методов управления рисками в разных сферах производственной деятельности предприятия, формирования у студентов умения распознавать экономические и производственными риски, анализировать возможные угрозы и выбирать наиболее эффективные методы и рекомендации по минимизации рисков при управлении производственными системами.

## 1.3. Задачи дисциплины

- выработка представлений об экономических и производственных рисках в деятельности предприятия, сущности, особенностях, элементах и разновидностях рисков;
- выбор методов выявления риска, его оценка и определение пределов допустимого риска;
- овладение технологией применения на практике наиболее эффективных методов управления экономическими и производственными рисками предприятия.

## 1.4. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код компетенции	Формулировка компетенции	Этап формирования
ПК-9	Способность оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли	Второй
<b>Планируемые результаты обучения</b> Знать: Классификацию, принципы и методы оценки рисков, способы идентификации рисков Уметь: Оценивать эффективность методов качественного и количественного анализа рисков Владеть: Навыками идентификации и управления рыночными и специфическими рисками деятельности предприятия		
ПК-15	Умение проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	Второй
<b>Планируемые результаты обучения</b> Знать: Понятия и подходы к оценке рыночных и специфических рисков Уметь: Обосновывать принятие управленческих решений в условиях риска и неопределенности по инвестированию и финансированию Владеть: Навыками оценки рисков управленческих решений по инвестированию и финансированию в условиях неполноты информации		

## 1.5. Дисциплины (практики) образовательной программы, в которых было начато формирование компетенций, указанных в п.1.4:

- Маркетинг (ПК-9).

- Экономика предприятия (ПК-15);

## 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование и содержание учебных модулей, тем и форм контроля	Объем (часы)		
	очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
<b>Учебный модуль 1. Природа риска и его содержание</b>			
Тема 1. Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Риск и неопределенность. Сущность и содержание предпринимательского риска. Концепция приемлемого риска. Классификации рисков. Основные принципы классификации рисков. Общая классификация рисков. Сущность и содержание экономических рисков. Сущность и содержание производственных рисков	11		15
Тема 2. Управление риском: сущность и содержание. Оперативное управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта. Управление рисками проектов долгосрочных инвестиций на основе реальных опционов. Политика управления рисками.	11		16
<b>Текущий контроль 1 (устный опрос)</b>	10		-
<b>Учебный модуль 2. Методы управления рисками</b>			
Тема 3. Концепции минимизации риска и приемлемого риска. Механизмы нейтрализации риска. Средства разрешения риска. Приемы снижения степени риска. Методы компенсации риска.	11		15
Тема 4. Методы управления риском. Классификация методов управления рисками. Признаки классификации: сферам деятельности, фазам проектного цикла, видам получателей выгод. Классификация способов воздействия на риск (снижение, сохранение, передача). Дособытийные и послесобытийные мероприятия по управлению рисками. Содержание методов управления рисками: уклонение, локализация, диверсификация (диссипация), компенсация.	11		16
<b>Текущий контроль 2 (проверочная работа)</b>	10		-
<b>Учебный модуль 3. Идентификация и анализ рисков в деятельности организации</b>			
Тема 5. Система идентификации факторов риска. Процедуры анализа рисков: качественный и количественный подход. Метод экспертных оценок, SWOT-анализ, роза (звезда) и спираль рисков, метод аналогий, метод ставки процента с поправкой на риск, метод критических значений. Идентификация опасностей или инцидентов. Карта потоков производства, прямая инспекция, причинно-следственная диаграмма (диаграмма Исикавы).	11		16
Тема 6. Управление экономическими и производственными рисками на основе метода анализа иерархий. Анализ иерархических систем в задачах риск - анализа. Идентификация наиболее значимых риск - факторов с помощью метода анализа иерархий	11		15
<b>Текущий контроль 3 (проверочная работа)</b>	10		-
<b>Учебный модуль 4. Количественные методы управления рисками</b>			
Тема 7. Факторы и модели оценки риска финансовой несостоятельности предприятия. Динамика развития моделей оценки риска банкротства предприятия. Дискриминантные факторные модели прогнозирования банкротства предприятия.	11		15
Тема 8. Принятие решений в условиях риска и неопределенности. Основные понятия теории статистических решений. Принятие решений по критерию Байеса-Лапласа. Принятие решений с помощью дерева решений (позиционные или многоэтапные игры). Принятие решений в условиях полной неопределенности (игры с природой). Понятие игры с природой. Принятие решений по максимальному критерию Вальда. Принятие решений по критерию минимаксного риска Сэвиджа-Ниганса. Принятие решений по критерию пессимизма-оптимизма Гурвица. Принятие решений по критерию недостаточного основания Лапласа.	12		16
<b>Текущий контроль 4 (проверочная работа)</b>	10		-
<b>Учебный модуль 5. Математические модели управления рисками. Статистическое моделирование.</b>			

Наименование и содержание учебных модулей, тем и форм контроля	Объем (часы)		
	очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Тема 9. Математические модели управления экономическими и производственными рисками. Оценка рисков на основе метода «Анализ безубыточности». Механизм управления риском на основе американской модели финансового рычага. Механизм управления риском на основе европейской модели финансового рычага. Механизм комплексного управления экономическим и производственным рисками. Оценка рисков на основе метода «Анализ чувствительности». Оценка риска на основе метода «анализа сценариев». Правило «трех сигм». Способы реализации оптимизационных подходов к управлению рисками. Оптимальное управление рисками, заключающееся в минимизации вероятности риска инвестиционного проекта при обеспечении ожидаемой эффективности проекта, не меньшей заданного минимально допустимого значения показателя эффективности. Оптимальное управление рисками, заключающееся в максимизации ожидаемой эффективности проекта при необходимости обеспечения уровня вероятности риска проекта, не превышающего заданного максимально возможного значения показателя рискованности проекта.	12		16
Тема 10. Анализ и управление рисками на основе применения статистического моделирования. Общая характеристика метода статистического (имитационного) моделирования. Основные этапы построения статистической модели исследуемого процесса. Теоретические основы метода статистических испытаний (метода Монте-Карло). Алгоритм построения и анализа имитационной модели производственной системы. Анализ риска решений с помощью метода статистических испытаний.	11		16
<b>Текущий контроль 5</b> (проверочная работа)	10		-
Контрольная работа	-		20
<b>Промежуточная аттестация по дисциплине (зачет с оценкой)</b>	<b>18</b>		<b>4</b>
<b>ВСЕГО:</b>	<b>180</b>		<b>180</b>

### 3. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН

#### 3.1. Лекции

Номера изучаемых тем	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
1	6	2			-	-
2	6	2			6	2
3	6	2			-	-
4	6	2			6	2
5	6	2			-	-
6	6	2			7	1
7	6	2			-	-
8	6	1			7	1
9	6	1			7	1
10	6	1			7	1
<b>ВСЕГО:</b>		<b>17</b>				<b>8</b>

#### 3.2. Практические и семинарские занятия

Номера изучаемых тем	Наименование практических занятий	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
		Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
1	Оценка экономического риска. Применение статистического, экспертного и расчетно-аналитического методов	6	4			-	-

	оценки риска. Определение допустимых пределов риска.						
5	Качественный анализ экономических и производственных рисков. Решение задачи анализа рисков предприятия с помощью «розы» и «спирали» рисков.	6	4			7	1
6	Идентификация наиболее значимых риск - факторов виртуального предприятия с помощью метода анализа иерархий.	6	4			7	1
7	Прогнозирование банкротства полиграфического предприятия с использованием дискриминантного анализа.	6	4			-	-
8	Принятие решений при выборе стратегий поведения предприятия в условиях риска с использованием метода дерева решений.	6	4			-	
8	Принятие решений в условиях риска при управлении предприятием. Решение задачи выбора оптимального решения по критерию Байеса-Лапласа.	6	4			7	1
8	Принятие решений в условиях полной неопределенности. Выбор оптимальной стратегии предприятия по критерию Вальда и по критерию Сэвиджа-Ниганса.	6	4			-	-
8	Принятие решений в условиях полной неопределенности. Выбор оптимальной стратегии предприятия по критерию Гурвица и критерию недостаточного основания Лапласа.	6	4			-	-
9	Решение задачи оценки рисков на основе методов «Анализ чувствительности» и «Анализ сценариев».	6	2			7	1
<b>ВСЕГО:</b>			<b>34</b>				<b>4</b>

### 3.3. Лабораторные занятия

Не предусмотрено

## 4. КУРСОВОЕ ПРОЕКТИРОВАНИЕ

Не предусмотрено

### 5. ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ

Номера учебных	Форма	Очное обучение	Очно-заочное обучение	Заочное обучение
----------------	-------	----------------	-----------------------	------------------

модулей, по которым проводится контроль	контроля знаний	Номер семестра	Кол-во	Номер семестра	Кол-во	Номер семестра	Кол-во
1	Устный опрос	6	1			-	-
2-5	Проверочная работа	6	5			-	-
1-5	Контрольная работа	-	-			7	1

## 6. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩЕГОСЯ

Виды самостоятельной работы обучающегося	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
Усвоение теоретического материала	6	50			6 7	14 58
Подготовка к практическим занятиям	6	61			7	72
Написание контрольной работы	6	-			7	20
Подготовка к дифференцированному зачету	6	18			7	4
<b>ВСЕГО:</b>		<b>129</b>				<b>168</b>

## 7. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

### 7.1. Характеристика видов и используемых инновационных форм учебных занятий

Наименование видов учебных занятий	Используемые инновационные формы	Объем занятий в инновационных формах (часы)		
		очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Лекции	<i>Разбор конкретных ситуаций профессиональной деятельности</i>	4		2
Практические занятия	<i>Деловая игра, поиск вариантов решения проблемных ситуаций (case-study), работа в малых группах</i>	14		2
<b>ВСЕГО:</b>		<b>18</b>		<b>4</b>

### 7.2. Балльно-рейтинговая система оценивания успеваемости и достижений обучающихся Перечень и параметры оценивания видов деятельности обучающегося

№ п/п	Вид деятельности обучающегося	Весовой коэффициент значимости, %	Критерии (условия) начисления баллов
1	Активность на аудиторных занятиях	35	- Посещение лекций – 2 балла за каждую лекционную тему (всего 10 тем, максимум <b>20</b> баллов); - Выполнение практических работ и своевременная сдача отчета – 3 балла за каждое занятие (всего 9 занятий по 4 часа, максимум <b>27</b> балла); - Прохождение текущего контроля: активность при устном опросе – 3 балла (1 опрос в семестр, максимум <b>3</b> балла); правильно выполненное проверочное задание – 10 баллов (4 задания в семестре, максимум <b>40</b> баллов); доклад при работе в малой группе 10 баллов (1 доклад в семестр, максимум <b>10</b> баллов).
2	Проведение в рамках дисциплины самостоятельного научно-исследовательского эксперимента, презентация его результатов, либо участие в студенческой	25	- 50 баллов за презентацию результатов экспериментов на занятии (всего 1 презентация в семестре), максимум <b>50</b> баллов; - 50 баллов за выступление на студенческой конференции "Дни науки" с публикацией тезисов доклада, максимум <b>50</b> баллов

	конференции «Дни науки» с публикацией тезисов доклада		
3	Сдача дифференцированного зачета	40	Ответ на теоретический вопрос (полнота, владение терминологией, затраченное время) – максимум <b>50</b> баллов; Выполнение практического задания (1 задание), максимум <b>50</b> баллов.
<b>Итого (%):</b>		100	

#### Перевод балльной шкалы в традиционную систему оценивания

Баллы	Оценка по нормативной шкале	
86 - 100	5 (отлично)	Зачтено
75 – 85	4 (хорошо)	
61 – 74		
51 - 60		
40 – 50	3 (удовлетворительно)	Не зачтено
17 – 39	2 (неудовлетворительно)	
1 – 16		
0		

## 8. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

### 8.1. Учебная литература

#### а) основная учебная литература

1. Антикризисное управление. Теория и практика : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления / В. Я. Захаров, А. О. Блинов, Д. В. Хавин [и др.] ; под редакцией В. Я. Захаров. — 2-е изд. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 304 с. — ISBN 978-5-238-01513-2. — Текст: электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/71189.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей.
2. Моделирование экономических процессов : учебник для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления / Е. Н. Лукаш, В. А. Чахоян, Ю. Н. Черемных [и др.]; под редакцией М. В. Грачева, Ю. Н. Черемных, Е. А. Туманова. — 2-е изд. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 543 с. — ISBN 978-5-238-02329-8. — Текст: электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/74952.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей.
3. Рахимова, Н. Н. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебное пособие / Н. Н. Рахимова. — Оренбург: Оренбургский государственный университет, ЭБС АСВ, 2016. — 191 с. — ISBN 978-5-7410-1538-4. — Текст: электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/69961.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей

#### б) дополнительная учебная литература

1. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник для бакалавров / А. Н. Фомичев. — 5-е изд. — Москва : Дашков и К, 2018. — 372 с. — ISBN 978-55394-02911-0. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/85667.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей
2. Оценка рисков в проектном менеджменте : учебное пособие / Е. И. Капустина, О. П. Григорьева, Ю. С. Скрипниченко [и др.]. — Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет, 2017. — 152 с. — ISBN 2227-8397. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/76047.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей
3. Балдин, К. В. Управление рисками : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления (060000) / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. — 511 с. — ISBN 5-238-00861-9. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/71229.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей
4. Панягина, А. Е. Управление рисками на предприятии: теория и практика : учебное пособие / А. Е. Панягина, А. В. Свистунов. — Москва : Ай Пи Ар Медиа, 2020. — 284 с. — ISBN 978-5-4497-0608-9. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/96561.html>. — Режим доступа: для авторизир. пользователей



## 8.2. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

1. Управление предпринимательскими рисками. Практические занятия. Самостоятельная работа [Электронный ресурс]: методические указания / Сост. Чигиринова М. В. — СПб.: СПбГУПТД, 2017.— 24 с.— Режим доступа: [http://publish.sutd.ru/tp\\_ext\\_inf\\_publish.php?id=2017621](http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=2017621), по паролю.
2. Риск-менеджмент. Практические занятия. Самостоятельная работа [Электронный ресурс]: методические указания / Сост. Чигиринова М. В. — СПб.: СПбГУПТД, 2017.— 25 с.— Режим доступа: [http://publish.sutd.ru/tp\\_ext\\_inf\\_publish.php?id=2017619](http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=2017619), по паролю.
3. Томасова Д. А. Операционный менеджмент. Анализ и управление операционными рисками предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие / Томасова Д. А. — СПб.: СПбГУПТД, 2019.— 93 с.— Режим доступа: [http://publish.sutd.ru/tp\\_ext\\_inf\\_publish.php?id=2019374](http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=2019374), по паролю.

## 8.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины

1. ЭБС IPRbooks <http://www.iprbookshop.ru>
2. <http://publish.sutd.ru>
4. Электронно-библиотечная система Znanium.com - <http://znanium.com/>
5. Электронно-библиотечная система «КнигаФонд» - <http://www.knigafund.ru/>

Административно-управленческий портал AUP.Ru. Электронные книги по экономико-математическим методам и моделям - <http://www.aup.ru/books/i008.htm>

## 8.4. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

1. Windows 7
2. MicrosoftOfficeStandart 2016 RussianOpenNoLevelAcademic

## 8.5. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

1. Видеопроектор;
2. Экран;
3. Компьютер, имеющий выход в сеть Интернет;
4. Доска.

## 8.6. Иные сведения и (или) материалы

# 9. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Виды учебных занятий и самостоятельная работа обучающихся	Организация деятельности обучающегося
Лекции	Лекции обеспечивают теоретическое изучение дисциплины, способствуют воспитанию у студентов профессиональных качеств, развитию у них самостоятельного мышления. На лекциях излагается основное содержание курса, иллюстрируемое конкретными примерами деловых ситуаций анализа и управления экономическими и производственными рисками предприятия. Освоение лекционного материала обучающимся предполагает следующие виды работ: - проработка рабочей программы в соответствии с целями и задачами, структурой и содержанием дисциплины; - конспект лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы и формулировки; помечать важные мысли, выделять ключевые слова, термины.
Практические занятия	На практических занятиях разъясняются теоретические положения курса. Обучающиеся работают с конкретными деловыми ситуациями (кейсами), связанными с выявлением, анализом и управлением экономическими и производственными рисками предприятия; овладевают навыками сбора, анализа и обработки информации для управления рисками в производственной обстановке, навыками применения полученных теоретических знаний для решения конкретных задач управления рисками; навыками работы в малых группах; развивают организаторские способности при подготовке коллективных решений в области риск - менеджмента. Перед выполнением практических работ следует предварительно изучить методические указания по их выполнению
Самостоятельная работа	Самостоятельная работа направлена на расширение и закрепление знаний, умений и навыков, усвоенных на аудиторных занятиях путем самостоятельной проработки учебно-методических материалов по дисциплине и другим источникам информации; подготовку к защите отчетов по практическим занятиям; к текущему контролю по

Виды учебных занятий и самостоятельная работа обучающихся	Организация деятельности обучающегося
	дисциплине, а также подготовку к дифференцированному зачету. Самостоятельная работа выполняется индивидуально. При подготовке к дифференцированному зачету необходимо ознакомиться с перечнем вопросов, проработать конспекты лекций и практических занятий, рекомендуемую литературу, получить консультацию у преподавателя.

## 10. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

### 10.1. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

#### 10.1.1. Показатели оценивания компетенций на этапах их формирования

Код компетенции / этап освоения	Показатели оценивания компетенций	Наименование оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
ПК-9/второй	Объясняет основные определения и виды рисков, классифицирует методы идентификации рисков	Вопросы для устного собеседования	Перечень вопросов для устного собеседования (47 вопросов)
	Выявляет и оценивает рыночные и специфические риски функционирования организации. Определяет контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения	Практическое задание	Практические задания (3 варианта заданий)
	Использует методы идентификации и минимизации рыночных и специфических рисков предприятия. Осуществляет мониторинг рисков и мониторинг мероприятий по воздействию на риски		
ПК-15/первый	Интерпретирует аналитические методы анализа рыночных и специфических рисков	Вопросы для устного собеседования	Перечень вопросов для устного собеседования (47 вопросов)
	Проводит расчет показателей риска, используемых для обоснования управленческих решений по инвестированию и финансированию	Практическое задание	Практические задания (3 варианта заданий)
	Применяет современные информационно-аналитические системы для анализа и управления инвестиционными и финансовыми рисками		

#### 10.1.2. Описание шкал и критериев оценивания сформированности компетенций

##### Критерии оценивания сформированности компетенций

Баллы	Оценка по традиционной шкале	Критерии оценивания сформированности компетенций
		Устное собеседование
86 - 100	5 (отлично)	Полный, исчерпывающий ответ, явно демонстрирующий глубокое понимание предмета и широкую эрудицию в оцениваемой области, умение использовать теоретические знания для решения практических задач. <b>Учитываются баллы, накопленные в течение семестра.</b>
75 – 85	4 (хорошо)	Ответ полный и правильный, основанный на проработке всех обязательных источников информации. Подход к материалу ответственный, но допущены в ответах небольшие погрешности, которые устраняются только в результате собеседования <b>Учитываются баллы, накопленные в течение семестра.</b>
61 – 74		Ответ стандартный, в целом качественный, основан на всех обязательных источниках информации. Присутствуют небольшие пробелы в знаниях или

		несущественные ошибки. <b>Учитываются баллы, накопленные в течение семестра.</b>
51 - 60	3 (удовлетворительно)	Ответ воспроизводит в основном только лекционные материалы, без самостоятельной работы с рекомендованной литературой. Демонстрирует понимание предмета в целом при неполных, слабо аргументированных ответах. Присутствуют неточности в ответах, пробелы в знаниях по некоторым темам, существенные ошибки, которые могут быть найдены и частично устранены в результате собеседования <b>Учитываются баллы, накопленные в течение семестра.</b>
40 – 50		Ответ неполный, основанный только на лекционных материалах. При понимании сущности предмета в целом – пробелы в знаниях сразу по нескольким темам, существенные ошибки, устранение которых в результате собеседования затруднено. <b>Учитываются баллы, накопленные в течение семестра.</b>
17 – 39	2 (неудовлетворительно)	Неспособность ответить на вопрос без помощи экзаменатора. Незнание значительной части принципиально важных элементов дисциплины. Многочисленные грубые ошибки. <b>Не учитываются баллы, накопленные в течение семестра.</b>
1 – 16		Непонимание заданного вопроса. Неспособность сформулировать хотя бы отдельные концепции дисциплины. <b>Не учитываются баллы, накопленные в течение семестра.</b>
0		Попытка списывания, использования неразрешенных технических устройств или пользования подсказкой другого человека (вне зависимости от успешности такой попытки). <b>Не учитываются баллы, накопленные в течение семестра.</b>

**10.2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций**

**10.2.1. Перечень вопросов (тестовых заданий), разработанный в соответствии с установленными этапами формирования компетенций**

№ п/п	Формулировка вопросов	№ темы
1	Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Риск и неопределенность.	1
2	Сущность и содержание предпринимательского риска. Концепция приемлемого риска.	1
3	Классификации рисков. Основные принципы классификации рисков. Общая классификация рисков.	1
4	Сущность и содержание экономических рисков.	1
5	Сущность и содержание производственных рисков.	1
6	Управление риском: сущность и содержание.	2
7	Оперативное управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта.	2
8	Управление рисками проектов долгосрочных инвестиций на основе реальных опционов. Политика управления рисками.	2
9	Концепции минимизации риска и приемлемого риска.	3
10	Механизмы нейтрализации риска. Средства разрешения риска.	3
11	Приемы снижения степени риска. Методы компенсации риска.	3
12	Классификация методов управления рисками. Признаки классификации: сферам деятельности, фазам проектного цикла, видам получателей выгод.	4
13	Классификация способов воздействия на риск (снижение, сохранение, передача).	4
14	Дособытийные и послесобытийные мероприятия по управлению рисками.	4
15	Содержание метода управления рисками «Уклонение».	4
16	Содержание метода управления рисками «Локализация».	4
17	Содержание метода управления рисками «Диверсификация (диссипация)».	4
18	Содержание метода управления рисками «Компенсация».	4
19	Методы качественного анализа рисков. Метод экспертных оценок, SWOT-анализ, роза (звезда) и спираль рисков.	5
20	Методы качественного анализа рисков. Метод аналогий, метод ставки процента с поправкой на риск, метод критических значений.	5
21	Методы качественного анализа рисков. Идентификация опасностей или инцидентов. Карта потоков производства, прямая инспекция, причинно-следственная диаграмма (диаграмма Исикавы).	5
22	Управление экономическими и производственными рисками на основе метода анализа иерархий.	6
23	Анализ иерархических систем в задачах риск-анализа.	6
24	Идентификация наиболее значимых риск-факторов с помощью метода анализа иерархий.	6
25	Факторы и модели оценки риска финансовой несостоятельности предприятия.	7
26	Динамика развития моделей оценки риска банкротства предприятия.	7
27	Дискриминантные факторные модели прогнозирования банкротства предприятия.	7
28	Основные понятия теории статистических решений. Принятие решений по критерию Байеса-Лапласа.	8

29	Принятие решений с помощью дерева решений (позиционные или многоэтапные игры).	8
30	Принятие решений в условиях полной неопределенности. Принятие решений по максиминному критерию Вальда.	8
31	Принятие решений в условиях полной неопределенности. Принятие решений по критерию минимаксного риска Сэвиджа-Ниганса.	8
32	Принятие решений в условиях полной неопределенности. Принятие решений по критерию пессимизма-оптимизма Гурвица.	8
33	Принятие решений в условиях полной неопределенности. Принятие решений по критерию недостаточного основания Лапласа.	8
34	Оценка рисков на основе метода «Анализ безубыточности».	9
35	Механизм управления риском на основе американской модели финансового рычага.	9
36	Механизм управления риском на основе европейской модели финансового рычага.	9
37	Механизм комплексного управления экономическим и производственным рисками.	9
38	Оценка рисков на основе метода «Анализ чувствительности».	9
39	Оценка риска на основе метода «Анализ сценариев». Правило «трех сигм».	9
40	Способы реализации оптимизационных подходов к управлению рисками.	9
41	Оптимальное управление рисками, заключающееся в минимизации вероятности риска инвестиционного проекта при обеспечении ожидаемой эффективности проекта, не меньшей заданного минимально допустимого значения показателя эффективности.	9
42	Оптимальное управление рисками, заключающееся в максимизации ожидаемой эффективности проекта при необходимости обеспечения уровня вероятности риска проекта, не превышающего заданного максимально возможного значения показателя рискованности проекта.	9
43	Общая характеристика метода статистического (имитационного) моделирования.	10
44	Основные этапы построения статистической модели исследуемого процесса.	10
45	Теоретические основы метода статистических испытаний (метода Монте-Карло).	10
46	Алгоритм построения и анализа имитационной модели производственной системы.	10
47	Оценка риска управленческих решений с помощью метода статистических испытаний.	10

**Вариант типовых заданий (задач, кейсов), разработанных в соответствии с установленными этапами формирования компетенций**

**Практическое задание**

№ п/п	Условия типовых задач (задач, кейсов)	Ответ																										
1	<p>Пусть издательская фирма предполагает выйти на рынок печатной продукции. Руководство фирмы, исходя из оценок возможных состояний рынка и собственных возможностей, сформулировало три альтернативных варианта стратегии - <math>X_1</math>, <math>X_2</math>, <math>X_3</math>. Проведенные маркетинговые исследования показали, что по уровню платёжеспособного спроса на издания рынок может находиться в трех различных состояниях - <math>S_1, S_2, S_3</math>. В таблице для каждой пары <math>X_i</math> и <math>S_j</math> приведены величины <math>U_{ij}</math> выигрыша (прибыли) фирмы. Вероятности различных состояний рынка известны.</p> <p style="text-align: right;">Таблица</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th rowspan="3">Вариант стратегии фирмы</th> <th colspan="3">Выигрыш (прибыль) <math>U_{ij}</math> (млн. руб.)</th> </tr> <tr> <th colspan="3">Состояние рынка</th> </tr> <tr> <th><math>S_1</math></th> <th><math>S_2</math></th> <th><math>S_3</math></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><math>X_1</math></td> <td>1,525</td> <td>1,275</td> <td>0,775</td> </tr> <tr> <td><math>X_2</math></td> <td>0,9</td> <td>1,9</td> <td>1,4</td> </tr> <tr> <td><math>X_3</math></td> <td>- 0,35</td> <td>- 0,65</td> <td>2,65</td> </tr> <tr> <td>Вероятность состояния рынка</td> <td>0,3</td> <td>0,5</td> <td>0,2</td> </tr> </tbody> </table> <p>Требуется выбрать оптимальный вариант стратегии фирмы по критерию Байеса – Лапласа.</p>	Вариант стратегии фирмы	Выигрыш (прибыль) $U_{ij}$ (млн. руб.)			Состояние рынка			$S_1$	$S_2$	$S_3$	$X_1$	1,525	1,275	0,775	$X_2$	0,9	1,9	1,4	$X_3$	- 0,35	- 0,65	2,65	Вероятность состояния рынка	0,3	0,5	0,2	$X_2$ - оптимальная стратегия
Вариант стратегии фирмы	Выигрыш (прибыль) $U_{ij}$ (млн. руб.)																											
	Состояние рынка																											
	$S_1$	$S_2$	$S_3$																									
$X_1$	1,525	1,275	0,775																									
$X_2$	0,9	1,9	1,4																									
$X_3$	- 0,35	- 0,65	2,65																									
Вероятность состояния рынка	0,3	0,5	0,2																									
2	<p><b>Принятие решений в условиях риска с использованием метода дерева решений.</b></p> <p>Фирма, специализирующаяся на проведении маркетинговых исследований, одновременно получила заказ на исследование трёх рынков - А, В, С. За каждое исследование, выполненное успешно и в срок, заказчик заплатит фирме по 200 тыс. руб.</p> <p>Информация о затратах, связанных с проведением исследований, и вероятностях их успешного выполнения представлена в таблице. Фирма постарается приложить все усилия, чтобы завершить исследования в срок, однако это может оказаться невозможным по не зависящим от неё причинам. В случае невыполнения исследования в срок заказчик его не оплатит, а понесённые фирмой затраты ничем не будут компенсированы.</p> <p style="text-align: right;">Таблица</p>	<p style="text-align: center;">Дерево решений</p> <p style="text-align: center;">Оптимальная стратегия</p>																										

Данные о проведении маркетинговых исследований			фирмы – исследование рынка А, так как при этой стратегии ожидаемая прибыль фирмы достигает максимального значения, равного 50 тыс. руб.
Рынок	Затраты, тыс. руб.	Вероятность успеха, %	
А	120	85	
В	100	70	
С	60	40	

Время и ресурсы фирмы ограничены, поэтому возможно выполнение только одного исследования.  
Требуется:  
1. Построить дерево решений и выбрать оптимальную стратегию фирмы, связанную с выполнением исследования определенного рынка, по критерию максимизации ожидаемой прибыли;  
2. Провести анализ чувствительности дерева решений к изменению следующих факторов:  
• вероятность успеха исследования рынка В;  
• затраты на проведение исследования рынка В.

---

3

Выбрать наиболее предпочтительный вариант развития предприятия с использованием вероятностной оценки получения ожидаемых доходов. Решение принимается на основе сравнения двух взаимоисключающих проектов развития предприятия:

- проект «Модернизация» – замена оборудования на более производительное;
- проект «Инновация» – приобретение нового оборудования для изготовления продукции.

Возможны следующие сценарии реализации проектов:

- оптимистический,
- наиболее вероятный,
- пессимистический.

Для каждого варианта проекта заданы значения уровней годового дохода (NFV) и вероятностей получения этих уровней дохода (P), соответствующие каждому сценарию реализации проекта (см. таблицу).

Таблица

Чистый годовой доход и вероятность его получения

Вариант проекта	Сценарии реализации проекта	Чистый годовой доход, тыс. ден. ед. (NFV)	Вероятность получения дохода (P)
«Модернизация»	Пессимистический	500	0,2
	Наиболее вероятный	600	0,6
	Оптимистический	700	0,2
«Инновация»	Пессимистический	300	0,1
	Наиболее вероятный	600	0,8
	Оптимистический	1200	0,1

Требуется:  
1. Рассчитать математическое ожидание, среднее квадратическое отклонение и коэффициент вариации дохода для каждого варианта проекта.  
2. Выбрать наиболее предпочтительный вариант проекта по критерию минимизации риска.

$M_1 = 600$   
 $M_2 = 630$   
 $D_1 = 10000$   
 $D_2 = 217350$   
 $\sigma_1 = 100$   
 $\sigma_2 = 466,2$   
 $V_1 = \sigma_1/M_1 = 100/600=0,166$   
 $V_2 = \sigma_2/M_2 = 466,2/630=0,073$

Так как  $V_2 < V_1$ , то следует выбрать менее рискованный вариант проекта «Инновация».

**10.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, владений (навыков и (или) практического опыта деятельности), характеризующих этапы формирования компетенций**

**10.3.1. Условия допуска обучающегося к сдаче (экзамена, зачета и / или защите курсовой работы) и порядок ликвидации академической задолженности**

Положение о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся (принято на заседании Ученого).

**10.3.2. Форма проведения промежуточной аттестации по дисциплине**

устная  письменная  компьютерное тестирование  иная

**10.3.3. Особенности проведения (экзамена, зачета и / или защиты курсовой работы)**

При проведении зачета время, отводимое на подготовку к ответу, составляет не более 40 мин. Для выполнения практического задания обучающемуся предоставляется право пользоваться необходимой справочной информацией.

Сообщение результатов обучающемуся производится непосредственно после устного ответа.