

Министерство образования и науки 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.08.01

Риск-менеджмент

(Индекс дисциплины)

(Наименование дисциплины)

Кафедра: 28 менеджмента

Код

Наименование кафедры

Направление подготовки:

38.03.02.- Менеджмент

Профиль подготовки:

Управленческий консалтинг

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	72		72
	Аудиторные занятия	34		16
	Лекции	17		8
	Лабораторные занятия			
	Практические занятия	17		8
	Самостоятельная работа	38		52
	Промежуточная аттестация			4
Формы контроля по семестрам (номер семестра)	Экзамен			
	Зачет	7		9
	Контрольная работа			9
	Курсовой проект (работа)			
Общая трудоемкость дисциплины (зачетные единицы)		2		2

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

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент

на основании учебных планов № 1/1/789, 1/3/788.

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 анализа и управления рисками в разных сферах деятельности, принятия решений по выбору наиболее эффективных методов управления и минимизации рисков.

1.1. Задачи дисциплины

- раскрыть этапы и тенденции мирового опыта исследования рисков, теории рискологии
- раскрыть принципы выбора методов выявления риска, его оценки и определения пределов допустимого риска;
- продемонстрировать особенности разработки методов управления риском,
- и другие

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

Код компетенции	Формулировка компетенции	Этап формирования
ПК-9	способностью 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	Третий

Планируемые результаты обучения

Знать:

1) Контекст процесса управления рисками; методы идентификации риска международной организации, методы анализа и оценки риска (анализ существующих контролей и методов по управлению рисками и их достаточность, анализ последствий рисков, анализ возможностей и оценка вероятности, предварительный анализ, оценка неопределенности и чувствительности), с учетом поведения потребителей экономических благ на локальных и глобальных рынках; основные положения международных стандартов по риск- менеджменту и смежным вопросам

Уметь:

1) Определять контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения; идентифицировать изменения уровня рисков; определять эффективные методы воздействия на риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками международной деятельности

Владеть:

1) Навыками и опытом применения методов организации и проведения анализа и оценки рисков; разработки мероприятий по управлению рисками совместно с ответственными за риск сотрудниками международной организации; определения реестра рисков, построение карты рисков; мониторинга рисков и мониторинга мероприятий по воздействию на риски

Код компетенции	Формулировка компетенции	Этап формирования
ПК-15	умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	третий
<p>Планируемые результаты обучения</p> <p>Знать:</p> <p>1) Методы идентификации риска международной организации, методы анализа и оценки риска (анализ существующих контролей и методов по управлению рисками и их достаточность, анализ последствий рисков, анализ возможностей и оценка вероятности, предварительный анализ, оценка неопределенности и чувствительности) с учетом поведения потребителей экономических благ на локальных и глобальных рынках</p> <p>Уметь:</p> <p>1) Определять содержание процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения; идентифицировать изменения уровня рисков; определять эффективные методы воздействия на риск, разрабатывать и внедрять планы воздействия на риски (совместно с ответственными за риск сотрудниками), оказывать помощь ответственным за риск сотрудникам в правильной оценке риска и разработке мероприятий по их управлению; осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками международной деятельности</p> <p>Владеть:</p> <p>1) Навыками и опытом применения методов проведения анализа и оценки рисков; разработки мероприятий по управлению рисками совместно с ответственными за риск сотрудниками международной организации; определения реестра рисков, построение карты рисков; мониторинга рисков и мониторинга мероприятий по воздействию на риски</p>		

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

- ПК-9 - Государственное и муниципальное управление. Управление рекламной деятельностью Маркетинг, Антикризисный менеджмент, Исследование конъюнктуры рынка
- ПК- 15 Финансовый менеджмент, Антикризисный менеджмент, Инвестиционный менеджмент. Страховой менеджмент

2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование и содержание учебных модулей, тем и форм контроля	Объем (часы)		
	очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Учебный модуль 1. Общие принципы и понятия риск-менеджмента, история возникновения рискологии			
Тема 1 История развития рискологии. Зарубежный опыт риск-менеджмента. Неопределенность. Неопределенность и риск предпринимательской деятельности.	4		4
Тема 2 Понятие риска. Риск и неопределенность. Характеристики и элементы риска.	4		4
Тема 3 Классификация рисков. Критерии классификации. Риски в различных сферах деятельности.	10		6
Тема 4 Идеология риск – менеджмента. Управление риском. Цели и методы управления риском. Этапы процесса управления риском.	4		6
Текущий контроль 1: расчетно-графическая работа	2		-
Учебный модуль 2. Применение инструментов риск – менеджмента			
Тема 5 Методы выявления наличия риска. Проблемно-ориентировочные	8		8

Наименование и содержание учебных модулей, тем и форм контроля	Объем (часы)		
	очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
таблицы, экстраполяционные модели, методы экспертного прогнозирования при выявлении риска. Визуализация риска. Определение уровня приемлемого риска и его пороговых значений. Методика рискованного капитала.			
Тема 6 Оценка риска. Идентификация и анализ предпринимательского риска. Качественные и количественные методы оценки риска. Объективные и субъективные методы оценки риска.	6		6
Тема 7 Пути снижения риска. Выбор методов снижения предпринимательского риска, их сущность и значение. Страхование.	6		6
Тема 8 Принятие рисков, ограничение рисков, уклонение от риска. Хеджирование риска, страхование рисков, продажа рисков, обеспечение рисков.	6		6
Тема 9 Финансирование риска. Затраты на риск. Методы и источники финансирования риска их применение и эффективность	4		4
Тема 10 Риск-менеджмент и культура компании.	2		4
Тема 11 Психологические пределы риска. Типы отношения предпринимателей к риску. Особенности личности, функции и задачи риск-менеджера.	4		4
Текущий контроль 2: расчетно-графическая работа	2		-
Текущий контроль : контрольная работа	-		10
Промежуточная аттестация по дисциплине (зачёт)	10		4
ВСЕГО:	72		72

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	7	1			8	0,5
2	7	1			8	0,5
3	7	1			8	0,5
4	7	1			8	0,5
5	7	2			8	1
6	7	2			8	1
7	7	2			9	1
8	7	2			9	1
9	7	2			9	1
10	7	1			9	-
11	7	2			9	1
ВСЕГО:		17				8

3.2. Практические и семинарские занятия

Номера изучаемых тем	Наименование и форма занятий	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
		Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
3	Инвестиционные риски. Деловая игра «Портфельные риски».	7	6			9	4
5,6	Выявление и визуализация	7	2				-

Номера изучаемых тем	Наименование и форма занятий	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
		Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
	рисков. Имитационная задача.						
5	Экспертные процедуры оценки риска. Задача.	7	2			9	2
	Методы оценки риска. Задача.	7	4			9	2
6	Методы снижения риска. Задачи.	7	2				
11	Психологические пределы риска. Диагностика способности к управлению риском.	7	1			-	-
ВСЕГО:			17				8

3.3. Лабораторные занятия не предусмотрены

4. КУРСОВОЕ ПРОЕКТИРОВАНИЕ НЕ ПРЕДУСМОТРЕНО

5. ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ

Номера учебных модулей, по которым проводится контроль	Форма контроля знаний	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
		Номер семестра	Кол-во	Номер семестра	Кол-во	Номер семестра	Кол-во
1	расчетно-графическая работа	7	2				
2	контрольная работа					9	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	7	14			8	14
Подготовка к практическим (семинарским) занятиям	7	14			9	6
Выполнение домашних заданий	7				5	22
Подготовка к зачету	7	10			5	10
	7				9	4
ВСЕГО:		38				56

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

Наименование видов учебных занятий	Используемые инновационные формы	Объем занятий в инновационных формах (часы)		
		очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Лекции	проблемная лекция, разбор конкретных ситуаций, лекция-диалог,	8		2
Практические и семинарские занятия	дискуссия, поиск вариантов решения проблемных ситуаций case-study, презентация результатов практических заданий.	10		4
Лабораторные занятия	-			
ВСЕГО:		18		8

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	Аудиторная активность: посещение лекций и практических (семинарских) занятий, выступление с докладом	10	<ul style="list-style-type: none"> 2 балла за каждое занятие (всего 25 занятий в семестре), максимум 50 баллов 25 баллов за выполнение расчетно- графической работы (их две) всего 50 баллов,
2	Подготовка и представление устных докладов, рефератов либо участие в студенческой конференции «Дни науки» с публикацией тезисов доклада	20	<ul style="list-style-type: none"> 100 баллов за выступление на конференции.
3	Выполнение и защита практического задания	40	<ul style="list-style-type: none"> 50 баллов за выполнение расчетно- графической работы (их две) всего 100 баллов <p><i>Из них:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> Представление в срок и качество оформления – максимум 10 баллов; Содержание (соответствие заданию, наличие всех требуемых элементов, наличие и значимость ошибок) – максимум 25 баллов; Качество защиты (полнота ответов на вопросы, владение специальной терминологией, затраченное на ответы время) – максимум 15 баллов. (всего 50 -одна работа)
4	Сдача зачета	30	<ul style="list-style-type: none"> Ответ на теоретический вопрос (полнота, владение терминологией, затраченное время) – максимум 40 баллов; Решение практической задачи – до 30 баллов за каждую (всего 2 задачи), максимум 60 баллов.
Итого (%):		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. Фомичев А.Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров/ Фомичев А.Н.— Электрон. текстовые данные.— Москва: Дашков и К, 2018.— 372 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/85667.html>.— ЭБС «IPRbooks»
2. Бочкарева Н.А. Страхование и управление рисками на железнодорожном транспорте [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Бочкарева Н.А.— Электрон. текстовые данные.— Саратов: Ай Пи Эр Медиа, 2019.— 253 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/81321.html>.— ЭБС «IPRbooks»
3. Ларионова И.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Ларионова И.А.— Электрон. текстовые данные.— Москва: Издательский Дом МИСиС, 2017.— 32 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/98124.html>.— ЭБС «IPRbooks»
4. Пасько Е.А. Страхование и управление рисками [Электронный ресурс]: практикум/ Пасько Е.А.— Электрон. текстовые данные.— Ставрополь: Северо-Кавказский федеральный университет, 2017.— 106 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/69435.html>.— ЭБС «IPRbooks»
5. Балдин К.В. Управление рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления (060000)/ Балдин К.В., Воробьев С.Н.— Электрон. текстовые данные.— Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2017.— 511 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/71229.html>.— ЭБС «IPRbooks»

б) дополнительная учебная литература

1. Энциклопедия финансового риск-менеджмента [Электронный ресурс]/ В.Е. Барбаумов [и др.]— Электрон. текстовые данные.— Москва: Альпина Бизнес Букс, 2020.— 932 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/96867.html>.— ЭБС «IPRbooks»
2. Оценка рисков в проектном менеджменте [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Е.И. Капустина [и др.]— Электрон. текстовые данные.— Ставрополь: Ставропольский государственный аграрный университет, 2017.— 152 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/76047.html>.— ЭБС «IPRbooks»
3. Бочкарева Н.А. Страхование и управление рисками на железнодорожном транспорте [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Бочкарева Н.А.— Электрон. текстовые данные.— Саратов: Ай Пи Эр Медиа, 2019.— 253 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/81321.html>.— ЭБС «IPRbooks»

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

1. Чигиринова, М.В. Методические указания по дисц. «Риск-менеджмент» студентов направления 38.03.02 «Менеджмент» заочной формы обучения [Методические указания] / М.В.Чигиринова, – СПб.: ФГБОУВПО «СПГУТД», 2018
2. Чигиринова, М.В. Методические указания по дисц. «Управление предпринимательскими рисками» студентов направления 38.03.01 «Менеджмент» профиль «Страхование» для всех форм обучения [Методические указания] / М.В.Чигиринова, – СПб.: ФГБОУВПО «СПГУТД», 2017
3. Спицкий С. В. Эффективная аудиторная и самостоятельная работа обучающихся: методические указания / С. В. Спицкий. — СПб.: СПбГУПТД, 2015. – Режим доступа: http://publish.sutd.ru/tp_get_file.php?id=2015811, по паролю

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

1. Официальные сайты учреждений и организаций; образовательные ресурсы (например, Информационная система «Единое окно доступа к образовательным ресурсам» [Электронный ресурс]. URL: <http://window.edu.ru/>)
иные информационные ресурсы сети «Интернет», необходимые для освоения дисциплины

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

1. Windows 10, OfficeStd 2016 RUS OLP NL Acdmc

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

1. Стандартно оборудованная аудитория, видеопроектор с экраном, компьютер.

8.6. Иные сведения и (или) материалы

Компьютерные презентации, раздаточные иллюстративные материалы,

3. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Виды учебных занятий и самостоятельная работа обучающихся	Организация деятельности обучающегося
Лекции	<p>Лекции обеспечивают теоретическое изучение дисциплины. На лекциях излагается основное содержание курса, иллюстрируемое конкретными примерами, широко используется зарубежный и отечественный опыт по соответствующей тематике.</p> <p>Освоение лекционного материала обучающимся предполагает следующие виды работ:</p> <ul style="list-style-type: none">• конспект лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы и формулировки; помечать важные мысли, выделять ключевые слова, термины.• Проверка терминов, понятий: осуществлять с помощью энциклопедий;• работа с теоретическим материалом (конспектирование источников): найти ответ на вопросы в рекомендуемой литературе. <p>Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации или на практическом занятии.</p>
Практические занятия	<p>Разъясняются теоретические положения курса, обучающиеся работают с конкретными ситуациями, овладевают навыками сбора, анализа и обработки информации для принятия самостоятельных решений, навыками подготовки информационных обзоров и аналитических отчетов по соответствующей тематике; навыками работы в малых группах; развивают организаторские способности по подготовке коллективных проектов.</p> <p>Подготовка к практическим занятиям предполагает следующие виды работ:</p> <ul style="list-style-type: none">• работа с конспектом лекций;• подготовка ответов к контрольным вопросам;• просмотр рекомендуемых источников;• просмотр иллюстративного материала на презентации по теме (планировка торгового пространства, использование POS-материалов и пр.), решение кейсов и др.
Лабораторные занятия	-

Самостоятельная работа	<p>Данный вид работы предполагает расширение и закрепление знаний, умений и навыков, усвоенных на аудиторных занятиях путем самостоятельной проработки учебно-методических материалов по дисциплине и другим источникам информации; выполнения рефератов; подготовки к деловым играм; выполнение контрольной работы; а также подготовки к контрольным работам и зачету. Самостоятельная работа выполняется индивидуально, а также может проводиться под руководством (при участии) преподавателя.</p> <p>Следует предварительно изучить методические указания по выполнению самостоятельной работы, контрольной работы (можно указать реквизиты изданий и электронный ресурс, где они находятся).</p> <p>При подготовке к экзамену необходимо ознакомиться с демонстрационным вариантом задания (перечнем вопросов, пр.), проработать конспекты лекций и практических занятий, рекомендуемую литературу, получить консультацию у преподавателя.</p>
------------------------	---

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 третий	Перечисляет и характеризует функции и особенности рисков в международной деятельности; излагает классификационные признаки рисков, назначение классификации и требования к информации. излагает методы, инструменты управления и идентификации риска; выполняет сравнительный анализ видов риска международной деятельности	Устное собеседование	перечень вопросов для устного собеседования (с1-18 вопрос)
ПК-9 третий	Выявляет и анализирует рыночные и специфические риски. международной деятельности пользуясь стандартными методиками, классифицирует риски по видам, анализирует и обосновывает применяемые методы управления рисками организаций	Практическое задание	Перечень практических заданий (4 задачи)
ПК-9 третий	Применяет методы выявления и оценки риска международной деятельности; рассчитывает показатели количественной оценки риска на основе применения математического инструментария теории вероятностей; оценивает проекты международной деятельности организации с точки зрения возможных рисков для выбора оптимальной альтернативы.	Практическое задание	Перечень практических заданий (4 задачи)
ПК-15 третий	Перечисляет и характеризует функции и особенности рисков в международной деятельности. излагает классификационные признаки рисков, назначение классификации и требования к информации; излагает методы, инструменты управления и идентификации риска; выполняет сравнительный анализ видов риска международной деятельности	Устное собеседование	перечень вопросов для устного собеседования (с 19-31 вопрос)

Код компетенции / этап освоения	Показатели оценивания компетенций	Наименование оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
ПК-15 третий	Выявляет и анализирует рыночные и специфические риски. международной инвестиционной деятельности пользуясь стандартными методиками; классифицирует риски по видам; анализирует и обосновывает применяемые методы управления рисками международных организаций; прогнозирует возможные финансовые потери; обосновывает методы финансирования риска.	Практическое задание	Перечень практических заданий (5 задач)
ПК-15 третий	Применяет методы выявления и оценки риска международной деятельности для определения направлений инвестирования и целесообразности финансовых затрат; рассчитывает показатели количественной оценки риска на основе применения математического инструментария теории вероятностей; оценивает проекты международной деятельности организации с точки зрения возможных рисков при принятии решений об инвестировании и финансировании.	Практическое задание	Перечень практических заданий (5 задач)

10.1.2. Описание шкал и критериев оценивания сформированности компетенций

Критерии оценивания сформированности компетенций

Баллы	Оценка по традиционной шкале	Критерии оценивания сформированности компетенций
40 – 100	Зачтено	Обучающийся своевременно выполнил практические работы и представил результаты в форме презентации (Microsoft Office Power Point);, возможно допуская несущественные ошибки в ответе на вопросы преподавателя. Учитываются баллы, накопленные в течение семестра.
0 – 39	Не зачтено	Обучающийся не выполнил (выполнил частично) практические работы, не представил результаты в форме презентации (Microsoft Office Power Point, допустил существенные ошибки в ответе на вопросы преподавателя. Не учитываются баллы, накопленные в течение семестра.

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	История и предпосылки появления науки «Рискология».	1
2	Факторы, определяющие необходимость изучения и анализа рисков.	4
3	Сходство и различие понятий «риск» и «неопределенность».	1
4	Основные черты и элементы риска.	1
5	Риски, их особенности и классификация.	3
6	Критерии классификации рисков.	3
7	Внутренние и внешние риски.	3
8	Предпринимательские риски, основные черты и классификация.	3
9	Финансовые и коммерческие риски.	3
10	Внешние риски: страновой, валютный, налоговый и др.	3
11	Внутренние риски: организационный, ресурсный, портфельный, кредитный и инновационный.	3

12	Процесс управления рисками: цели, задачи и стадии управления.	4
13	Методы управления рисками.	5
14	Метод управления рисками: принятие риска.	8
15	Избегание риска, как один из методов управления рисками.	8
16	Снижение степени риска, варианты применения этого метода управления рисками.	7
17	Страхование как метод снижения риска.	7
18	Основные понятия и виды страхования.	7
19	Финансирование риска, выбор оптимального метода финансирования в зависимости от особенностей риска.	9
20	Способы выявления наличия риска, анализ и визуализация риска.	5
21	Применение проблемно-ориентировочных таблиц, математического прогнозирования, сценарного метода и метода Дельфи для выявления риска.	5
22	Методы анализа риска.	6
23	Качественная и количественная оценка риска.	6
24	Объективные и субъективные методы оценки риска.	6
25	Основные математические инструменты теории вероятностей, применяемые для оценки риска.	6
26	Величина ожидаемого риска. Вероятность риска, понятие «шанс».	6
27	Интегральная оценка риска.	6
28	Определение пороговых значений риска, понятие «рисковый капитал».	8
29	Принятие управленческих решений в ситуациях, связанных с риском.	10
30	Основные типы отношения предпринимателей к риску.	11
31	Значение личности риск-менеджера в процессе управления риском.	11

Вариант тестовых заданий, разработанных в соответствии с установленными этапами формирования компетенций - не предусмотрены

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

№ п/п	Условия типовых задач (задач, кейсов)	Ответ
1	Задача: Имеются два варианта вложения капитала. В первом варианте из 100 случаев в 55 был получен доход 100 тыс. р, в 45 случаях – 80 тыс. р. Во втором варианте из 160 случаев в 10 был получен доход 300 тыс. р., в 80 случаях – 110 тыс. р., в 70 случаях - 20 тыс. р. Необходимо выбрать наиболее доходный вариант вложения капитала.	Первый вариант предпочтительней, так как среднее ожидаемое значение дохода $X = 91$ т.р; в то время как во втором варианте это значение составит - 82,5 т.р
2	Задача: Вы располагаете определенным капиталом и рассматриваете альтернативные возможности вложения его либо в производство кинофильма, либо в торговлю. Вероятность успеха вложения капитала в кинофильм – 0,2, то же в торговлю – 0,7. Вероятность неуспеха вложения капитала в кинофильм – 0,8, то же в торговлю – 0,3. В случае успеха кинофильм дает 90 % прибыли, торговля – 30 %. В случае неуспеха кинофильм дает 10 %, торговля – 20 %. Куда выгоднее вложить капитал?	Вложение торговлю предпочтительнее, так как уровень средней доходности вложения в торговлю составит -27%; в то время как в кинофильм - 26%
3	Задача: На территории предприятия произошла авария водопровода. Общая длина трубопровода - 150 м, в том числе 50 м трубы	Риск составит -33%

	приходятся на труднодоступные места. Каков риск того, что ремонт придется производить на труднодоступном участке?	
4	Задача: Покупатель хочет купить у продавца товар на 10 млн р. Они оба обращаются в страховое общество, которое страхует сделку и покупателя и продавца. Страховой тариф составляет 10 %. Определить общую сумму страховой премии.	Общая сумма страховой премии составит - 2 млн. р.
5	Задача: Определить количество застрахованных объектов на предприятии, если страховая сумма по договору страхования составила 40 млн р. По страховому случаю было выплачено возмещение 12 млн р. Число пострадавших объектов - 4 при тяжести ущерба 0,6.	Количество застрахованных объектов на предприятии – 8 ед.

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 совета 31.08.2013г., протокол № 1)

10.3.2. Форма проведения промежуточной аттестации по дисциплине

устная письменная компьютерное тестирование иная*

*В случае указания формы «Иная» требуется дать подробное пояснение

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

Зачет проводится в письменной форме по утвержденным вопросам, билет включает три вопроса. Время на подготовку студента - 30 минут.