

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
 высшего образования
 «Иркутский государственный университет путей сообщения»
 (ФГБОУ ВО ИрГУПС)

УТВЕРЖДЕНА
 приказом ректора
 от «02» июня 2023 г. № 424-1

Б1.В.ДВ.05.01 Управление рисками

рабочая программа дисциплины

Специальность/направление подготовки – 38.04.01 Экономика

Специализация/профиль – Экономико-финансовое регулирование в транспортной отрасли

Квалификация выпускника – Магистр

Форма и срок обучения – очная форма 2 года; очно-заочная форма 2 года, 5 месяцев

Кафедра-разработчик программы – Финансовый и стратегический менеджмент

Общая трудоемкость в з.е. – 7

Часов по учебному плану (УП) – 252

В том числе в форме практической подготовки (ПП) – 8/8

(очная/очно-заочная)

Формы промежуточной аттестации

очная форма обучения:

зачет 2 семестр, экзамен 3 семестр

очно-заочная форма обучения:

зачет 2 семестр, экзамен 3 семестр

Очная форма обучения

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр	2	3	Итого
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП	Часов по УП
Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*	34/4	34/4	68/8
– лекции	17	17	34
– практические (семинарские)	17/4	17/4	34/8
– лабораторные			
Самостоятельная работа	74	74	148
Экзамен		36	36
Итого	108/4	144/4	252/8

Очно-заочная форма обучения

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр	2	3	Итого
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП	Часов по УП
Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*	30/4	30/4	60/8
– лекции	15	15	30
– практические (семинарские)	15/4	15/4	30/8
– лабораторные			
Самостоятельная работа	69	87	156
Зачет	9		9
Экзамен		27	27
Итого	108/4	144/4	252/8

* В форме ПП – в форме практической подготовки.

ИРКУТСК



Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – магистратура по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, утвержденным Приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 11.08.2020 № 939.

Программу составил(и):
к.э.н., доцент, доцент, Л.С. Бородавко

Рабочая программа рассмотрена и одобрена для использования в учебном процессе на заседании кафедры «Финансовый и стратегический менеджмент», протокол от «2» июня 2023 г. № 11

Зав. кафедрой, к.э.н., доцент

С.А. Халетская

1 ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ	
1.1 Цель дисциплины	
1	формирование компетенции в области планирования и координирования интегрированного процесса управления рисками в соответствии со стратегическими целями организации
1.2 Задачи дисциплины	
1	сформировать у обучающихся представление о процессе и этапах управления рисками;
2	сформировать у обучающихся основы владения подходами и методами оценки и анализа рисков деятельности организации;
3	сформировать у обучающихся навыки выбора и применения способов и инструментов управления рисками с учетом особенностей деятельности и стратегическими целями организации

2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	
Блок/часть ОПОП	Блок 1. Дисциплины / Часть, формируемая участниками образовательных отношений
2.1 Дисциплины и практики, на которых основывается изучение данной дисциплины	
1	Дисциплина изучается на начальном этапе формирования компетенции
2.2 Дисциплины и практики, для которых изучение данной дисциплины необходимо как предшествующее	
1	Б2.О.04(П) Производственная - организационно-управленческая практика
2	Б3.01(Д) Подготовка к процедуре защиты выпускной квалификационной работы
3	Б3.02(Д) Защита выпускной квалификационной работы

3 ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ТРЕБОВАНИЯМИ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ		
Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения
ПК-6.4 Способен планировать, координировать и осуществлять нормативное обеспечение интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации	ПК-6.4.1 Оценивает риски и координирует деятельность организаций (предприятий) по управлению рисками	Знать: основные методы и модели оценки рисков деятельности организаций (предприятия); методы, способы и инструменты обработки рисков
		Уметь: систематизировать и анализировать информацию о деятельности организации (предприятия), необходимую для оценки и анализа рисков; осуществлять оценку и анализ рисков деятельности организации (предприятия) с использованием различных математических и статистических моделей
		Владеть: навыками интерпретации результатов оценки и анализа рисков деятельности организаций (предприятия); навыками выбора способов управления рисками на основании результатов их оценки и анализа
	ПК-6.4.2 Разрабатывает и обосновывает нормативное обеспечение и содержание мероприятий по предотвращению и снижению рисков	Знать: нормативное обеспечение процесса управления рисками в организации; виды мероприятий по предотвращению и снижению рисков
		Уметь: осуществлять обоснованный выбор способов и инструментов управления рисками и разработку мероприятий по предотвращению и снижению рисков; формировать предложения по обоснованию нормативного обеспечения мероприятий по предотвращению и снижению рисков в организации
		Владеть: навыками координации деятельности организации по управлению рисками; навыками оценки эффективности процесса управления рисками

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ											
Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма				Очно-заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции	
		Семестр	Часы			Семестр	Часы				
			Лек	Пр	Лаб		СР	Лек	Пр		Лаб
1.0	Раздел 1. Основы управления рисками.										
1.1	Тема 1. Влияние рисков на деятельность организации	2	3	3	14	2	3	3		15	ПК-6.4.1

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ												
Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма				Очно-заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции		
		Семестр	Часы			Семестр	Часы					
			Лек	Пр	Лаб		СР	Лек	Пр		Лаб	СР
1.2	Тема 2. Этапы управления рисками. Уровни управления рисками	2	4	4		20	2	4	4		22	ПК-6.4.1
2.0	Раздел 2. Оценка рисков.											
2.1	Тема 3. Теоретические и методологические основы оценки рисков	2	3	3		14	2	2	2		15	ПК-6.4.1
2.2	Тема 4. Качественная и количественная оценка рисков	2	7	7/4		24	2	6	6/4		25	ПК-6.4.1
	Форма промежуточной аттестации – зачет	2					2	9				ПК-6.4.1
3.0	Раздел 3. Способы и инструменты управления рисками.											
3.1	Тема 5. Методические основы управления рисками	3	4	4		15	3	3	3		17	ПК-6.4.2
3.2	Тема 6. Виды способов и инструментов управления рисками	3	7	7/4		25	3	6	6/4		25	ПК-6.4.2
4.0	Раздел 4. Проектирование системы управления рисками.											
4.1	Тема 7. Политика в области управления рисками	3	2	2		14	3	2	2		15	ПК-6.4.2
4.2	Тема 8. Проектирование и внедрение системы управления рисками	3	4	4		22	3	4	4		22	ПК-6.4.2
	Форма промежуточной аттестации – экзамен	3	36				3	27				ПК-6.4.1 ПК-6.4.2
	Итого часов (без учёта часов на промежуточную аттестацию)		34	34/8		148		30	30/8		156	

5 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине оформлен в виде приложения № 1 к рабочей программе дисциплины и размещен в электронной информационно-образовательной среде Университета, доступной обучающемуся через его личный кабинет

6 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1 Учебная литература 6.1.1 Основная литература

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.1.1	Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие - 5-е изд., стер. / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. Москва : Дашков и К°, 2021. - 418с. - Текст:	Онлайн

	электронный. - URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=684196 (дата обращения: 14.09.2022)	
6.1.1.2	Каранина, Е. В. Управление рисками : механизмы, инструменты, профессиональные стандарты : учебник / Е. В. Каранина. Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2020. - 257с. - Текст: электронный. - URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576521	Онлайн
6.1.2 Дополнительная литература		
	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.2.1	Асламова, В. С. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учеб. пособие / В. С. Асламова, Е. А. Руш, Е. А. Асламова. Иркутск : ИрГУПС, 2017. - 176с.	18
6.1.2.2	Бурцева, Т. А. Моделирование и управление рисками : учебное пособие / Т. А. Бурцева. Москва : РГУ МИРЭА, 2020. - 131с. - Текст: электронный. - URL: https://e.lanbook.com/book/171446 (дата обращения: 19.04.2023)	Онлайн
6.1.2.3	Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник и практикум для вузов - 2-е изд. пер. и доп. Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. Москва : Юрайт, 2022. - 381с. - Текст: электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/489052 (дата обращения: 09.09.2022)	Онлайн
6.1.3 Учебно-методические разработки (в т. ч. для самостоятельной работы обучающихся)		
	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.3.1	Бородавко, Л.С. Методические указания по изучению дисциплины Б1.В.ДВ.05.01 Управление рисками по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, профиль Экономика-финансовое регулирование в транспортной отрасли / Л.С. Бородавко ; ИрГУПС. – Иркутск : ИрГУПС, 2022. – 14 с. - Текст: электронный. - URL: https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_5015_1519_2023_1_signed.pdf	Онлайн
6.2 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»		
6.2.1	Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» — https://cyberleninka.ru/	
6.2.2	Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU — https://elibrary.ru/	
6.2.3	Электронно-библиотечная система «Образовательная платформа ЮРАЙТ», https://urait.ru/	
6.3 Программное обеспечение и информационные справочные системы		
6.3.1 Базовое программное обеспечение		
6.3.1.1	Microsoft Windows Professional 10, государственный контракт от 20.07.2021 № 0334100010021000013-01	
6.3.1.2	Microsoft Office Russian 2010, государственный контракт от 20.07.2021 № 0334100010021000013-01	
6.3.1.3	FoxitReader, свободно распространяемое программное обеспечение http://free-software.com.ua/pdf-viewer/foxit-reader/	
6.3.1.4	Adobe Acrobat Reader DC свободно распространяемое программное обеспечение https://get.adobe.com/ru/reader/enterprise/	
6.3.1.5	Яндекс. Браузер. Прикладное программное обеспечение общего назначения, Офисные приложения, лицензия – свободно распространяемое программное обеспечение по лицензии BSD License	
6.3.2 Специализированное программное обеспечение		
6.3.2.1	Не предусмотрено	
6.3.3 Информационные справочные системы		
6.3.3.1	Не предусмотрены	
6.4 Правовые и нормативные документы		
6.4.1	Не предусмотрены	

7 ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ		
1	Корпуса А, Б, В, Г, Д, Е ИрГУПС находятся по адресу г. Иркутск, ул. Чернышевского, д. 15; корпус Л ИрГУПС находится – по адресу г. Иркутск, ул. Лермонтова, д.80	
2	Учебная аудитория Л-202 для проведения лекционных и практических занятий, лабораторных работ, групповых и индивидуальных консультаций, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), текущего контроля и промежуточной аттестации. Основное оборудование: специализированная мебель, мультимедиапроектор, экран, компьютер. Для проведения занятий имеются учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты)	

3	Учебная аудитория Л-307 для проведения лекционных и практических занятий, лабораторных работ, групповых и индивидуальных консультаций, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), текущего контроля и промежуточной аттестации.
4	Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, подключенной к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду ИрГУПС. Помещения для самостоятельной работы обучающихся: – читальные залы; – учебные залы вычислительной техники А-401, А-509, А-513, А-516, Д-501, Д-503, Д-505, Д-507; – помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования – А-521

8 МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Вид учебной деятельности	Организация учебной деятельности обучающегося
Лекция	<p>Лекция (от латинского «lection» – чтение) – вид аудиторных учебных занятий. Лекция: закладывает основы научных знаний в систематизированной, последовательной, обобщенной форме; раскрывает состояние и перспективы развития соответствующей области науки и техники; концентрирует внимание обучающихся на наиболее сложных, узловых вопросах; стимулирует познавательную активность обучающихся.</p> <p>Во время лекционных занятий обучающийся должен уметь сконцентрировать внимание на изучаемых проблемах и включить в работу все виды памяти: словесную, образную и моторно-двигательную. Для этого весь материал, излагаемый преподавателем, обучающемуся необходимо конспектировать. На полях конспекта следует пометить вопросы, выделенные обучающимся для консультации с преподавателем. Выводы, полученные в виде формул, рекомендуется в конспекте подчеркивать или обводить рамкой, чтобы лучше запоминались. Полезно составить краткий справочник, содержащий определения важнейших понятий лекции. К каждому занятию следует разобрать материал предыдущей лекции. Изучая материал по учебнику или конспекту лекций, следует переходить к следующему вопросу только в том случае, когда хорошо усвоен предыдущий вопрос. Ряд вопросов дисциплины может быть вынесен на самостоятельное изучение. Такое задание требует оперативного выполнения. В конспекте лекций необходимо оставить место для освещения упомянутых вопросов. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, то необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии</p>
Практическое занятие	<p>Практическое занятие – вид аудиторных учебных занятий, целенаправленная форма организации учебного процесса, при реализации которой обучающиеся по заданию и под руководством преподавателя выполняют практические задания. Практические задания направлены на углубление научно-теоретических знаний и овладение определенными методами работы, в процессе которых вырабатываются умения и навыки выполнения тех или иных учебных действий в данной сфере науки. Практические занятия развивают научное мышление и речь, позволяют проверить знания обучающихся, выступают как средства оперативной обратной связи; цель практических занятий – углублять, расширять, детализировать знания, полученные на лекции, в обобщенной форме и содействовать выработке навыков профессиональной деятельности.</p> <p>На практических занятиях подробно рассматриваются основные вопросы дисциплины, разбираются основные типы задач. К каждому практическому занятию следует заранее самостоятельно выполнить домашнее задание и выучить лекционный материал к следующей теме. Систематическое выполнение домашних заданий обязательно и является важным фактором, способствующим успешному усвоению дисциплины</p>
Самостоятельная работа	<p>Обучение по дисциплине «Управление рисками» предусматривает активную самостоятельную работу обучающегося. В разделе 4 рабочей программы, который называется «Структура и содержание дисциплины», все часы самостоятельной работы расписаны по темам и вопросам, а также указана необходимая учебная литература: обучающийся изучает учебный материал, разбирает примеры и решает разноуровневые задачи в рамках выполнения как общих домашних заданий, так и индивидуальных домашних заданий (ИДЗ) и других видов работ, предусмотренных рабочей программой дисциплины. При выполнении домашних заданий обучающемуся следует обратиться к задачам, решенным на предыдущих практических занятиях, решенным домашним работам, а также к примерам, приводимым лектором. Если этого будет недостаточно для выполнения всей работы можно дополнительно воспользоваться учебными пособиями, приведенными в разделе 6.1 «Учебная литература». Если, несмотря на изученный материал, задание</p>

	<p>выполнить не удастся, то в обязательном порядке необходимо посетить консультацию преподавателя, ведущего практические занятия, и/или консультацию лектора.</p> <p>Домашние задания, индивидуальные домашние задания и другие работы, предусмотренные рабочей программой дисциплины должны быть выполнены обучающимся в установленные преподавателем сроки в соответствии с требованиями к оформлению текстовой и графической документации, сформулированным в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль»</p>
<p>Комплекс учебно-методических материалов по всем видам учебной деятельности, предусмотренным рабочей программой дисциплины (модуля), размещен в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет</p>	

Приложение № 1 к рабочей программе

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

**для проведения текущего контроля успеваемости
и промежуточной аттестации**

1. Общие положения

Фонд оценочных средств (ФОС) является составной частью нормативно-методического обеспечения системы оценки качества освоения обучающимися образовательной программы.

Фонд оценочных средств предназначен для использования обучающимися, преподавателями, администрацией ИрГУПС, а также сторонними образовательными организациями для оценивания качества освоения образовательной программы и уровня сформированности компетенций у обучающихся.

Задачами ФОС являются:

- оценка достижений обучающихся в процессе изучения дисциплины;
- обеспечение соответствия результатов обучения задачам будущей профессиональной деятельности через совершенствование традиционных и внедрение инновационных методов обучения в образовательный процесс;
- самоподготовка и самоконтроль обучающихся в процессе обучения.

Фонд оценочных средств сформирован на основе ключевых принципов оценивания: валидность, надежность, объективность, эффективность.

Для оценки уровня сформированности компетенций используется трехуровневая система:

- минимальный уровень освоения, обязательный для всех обучающихся по завершению освоения образовательной программы; дает общее представление о виде деятельности, основных закономерностях функционирования объектов профессиональной деятельности, методов и алгоритмов решения практических задач;

- базовый уровень освоения, превышение минимальных характеристик сформированности компетенций; позволяет решать типовые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения по известным алгоритмам, правилам и методикам;

- высокий уровень освоения, максимально возможная выраженность характеристик компетенций; предполагает готовность решать практические задачи повышенной сложности, нетиповые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения в условиях неполной определенности, при недостаточном документальном, нормативном и методическом обеспечении.

2. Перечень компетенций, в формировании которых участвует дисциплина.

Программа контрольно-оценочных мероприятий. Показатели оценивания компетенций, критерии оценки

Дисциплина «Управление рисками» участвует в формировании компетенций:

ПК-6.4. Способен планировать, координировать и осуществлять нормативное обеспечение интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации

Программа контрольно-оценочных мероприятий очная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
2 семестр				
1.0	Раздел 1. Основы управления рисками			
1.1	Текущий контроль	Тема 1. Влияние рисков на деятельность организации	ПК-6.4.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Тема 2. Этапы управления рисками. Уровни управления рисками	ПК-6.4.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
2.0	Раздел 2. Оценка рисков			
2.1	Текущий контроль	Тема 3. Теоретические и методологические основы оценки рисков	ПК-6.4.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.2	Текущий контроль	Тема 4. Качественная и количественная оценка рисков	ПК-6.4.1	В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Основы управления рисками Раздел 2. Оценка рисков	ПК-6.4.1	Зачет (собеседование) Зачет - тестирование (компьютерные технологии)
3 семестр				
3.0	Раздел 3. Способы и инструменты управления рисками			
3.1	Текущий контроль	Тема 5. Методические основы управления рисками	ПК-6.4.2	Собеседование (устно)
3.2	Текущий контроль	Тема 6. Виды способов и инструментов управления рисками	ПК-6.4.2	В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
4.0	Раздел 4. Проектирование системы управления рисками			
4.1	Текущий контроль	Тема 7. Политика в области управления рисками	ПК-6.4.2	Собеседование (устно) Творческое задание (письменно)
4.2	Текущий контроль	Тема 8. Проектирование и внедрение системы управления рисками	ПК-6.4.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Основы управления рисками Раздел 2. Оценка рисков Раздел 3. Способы и инструменты управления рисками Раздел 4. Проектирование системы управления рисками	ПК-6.4.1 ПК-6.4.2	Экзамен (собеседование) Экзамен - тестирование (компьютерные технологии)

Программа контрольно-оценочных мероприятий очно-заочная форма обучения

№	Наименование контрольно-	Объект контроля	Код индикатора	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
---	--------------------------	-----------------	----------------	--

	оценочного мероприятия		достижения компетенции	
2 семестр				
1.0	Раздел 1. Основы управления рисками			
1.1	Текущий контроль	Тема 1. Влияние рисков на деятельность организации	ПК-6.4.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Тема 2. Этапы управления рисками. Уровни управления рисками	ПК-6.4.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
2.0	Раздел 2. Оценка рисков			
2.1	Текущий контроль	Тема 3. Теоретические и методологические основы оценки рисков	ПК-6.4.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.2	Текущий контроль	Тема 4. Качественная и количественная оценка рисков	ПК-6.4.1	В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Основы управления рисками Раздел 2. Оценка рисков	ПК-6.4.1	Зачет (собеседование) Зачет - тестирование (компьютерные технологии)
3 семестр				
3.0	Раздел 3. Способы и инструменты управления рисками			
3.1	Текущий контроль	Тема 5. Методические основы управления рисками	ПК-6.4.2	Собеседование (устно)
3.2	Текущий контроль	Тема 6. Виды способов и инструментов управления рисками	ПК-6.4.2	В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
4.0	Раздел 4. Проектирование системы управления рисками			
4.1	Текущий контроль	Тема 7. Политика в области управления рисками	ПК-6.4.2	Собеседование (устно) Творческое задание (письменно)
4.2	Текущий контроль	Тема 8. Проектирование и внедрение системы управления рисками	ПК-6.4.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Основы управления рисками Раздел 2. Оценка рисков Раздел 3. Способы и инструменты управления рисками Раздел 4. Проектирование системы управления рисками	ПК-6.4.1 ПК-6.4.2	Экзамен (собеседование) Экзамен - тестирование (компьютерные технологии)

*Форма проведения контрольно-оценочного мероприятия: устно, письменно, компьютерные технологии.

**ПП – практическая подготовка

Описание показателей и критериев оценивания компетенций.

Описание шкал оценивания

Контроль качества освоения дисциплины включает в себя текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию. Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация обучающихся проводятся в целях установления соответствия достижений обучающихся поэтапным требованиям образовательной программы к результатам обучения и формирования компетенций.

Текущий контроль успеваемости – основной вид систематической проверки знаний, умений, навыков обучающихся. Задача текущего контроля – оперативное и регулярное управление учебной деятельностью обучающихся на основе обратной связи и корректировки. Результаты оценивания учитываются в виде средней оценки при проведении промежуточной аттестации.

Для оценивания результатов обучения используется четырехбалльная шкала: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно» и двухбалльная шкала: «зачтено», «не зачтено».

Перечень оценочных средств, используемых для оценивания компетенций, а также краткая характеристика этих средств приведены в таблице.

Текущий контроль

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	Собеседование	Средство контроля на практическом занятии, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Может быть использовано для оценки знаний обучающихся	Вопросы для собеседования по темам/разделам дисциплины
2	Разноуровневые задачи (задания)	Различают задачи: – репродуктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать знание фактического материала (базовые понятия, алгоритмы, факты) и умение правильно использовать специальные термины и понятия, узнавание объектов изучения в рамках определенного раздела дисциплины; может быть использовано для оценки знаний и умений обучающихся; – реконструктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения синтезировать, анализировать, обобщать фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся; – творческого уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Комплект разноуровневых задач и заданий или комплекты задач и заданий определенного уровня
3	Творческое задание	Частично регламентированное задание, имеющее нестандартное решение и позволяющее диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения. Может выполняться в индивидуальном порядке или группой обучающихся. Может быть использовано для оценки знаний, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Темы творческих заданий

Промежуточная аттестация

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	Зачет	Средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Перечень теоретических вопросов и практических заданий к зачету
2	Тест – промежуточная аттестация в форме зачета	Система автоматизированного контроля освоения компетенций (части компетенций) обучающимся по дисциплине (модулю) с использованием информационно-коммуникационных технологий. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Фонд тестовых заданий

3	Экзамен	Средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Перечень теоретических вопросов и практических заданий (образец экзаменационного билета) к экзамену
4	Тест – промежуточная аттестация в форме экзамена	Система автоматизированного контроля освоения компетенций (части компетенций) обучающимся по дисциплине (модулю) с использованием информационно-коммуникационных технологий. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Фонд тестовых заданий

Критерии и шкалы оценивания компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета и экзамена. Шкала оценивания уровня освоения компетенций

Шкалы оценивания		Критерии оценивания	Уровень освоения компетенции
«отлично»	«зачтено»	Обучающийся правильно ответил на теоретические вопросы. Показал отличные знания в рамках учебного материала. Правильно выполнил практические задания. Показал отличные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на все дополнительные вопросы	Высокий
«хорошо»		Обучающийся с небольшими неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал хорошие знания в рамках учебного материала. С небольшими неточностями выполнил практические задания. Показал хорошие умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на большинство дополнительных вопросов	Базовый
«удовлетворительно»		Обучающийся с существенными неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал удовлетворительные знания в рамках учебного материала. С существенными неточностями выполнил практические задания. Показал удовлетворительные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Допустил много неточностей при ответе на дополнительные вопросы	Минимальный
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Обучающийся при ответе на теоретические вопросы и при выполнении практических заданий продемонстрировал недостаточный уровень знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. При ответах на дополнительные вопросы было допущено множество неправильных ответов	Компетенция не сформирована

Тест – промежуточная аттестация в форме зачета и экзамена

Шкала оценивания	Критерии оценивания
------------------	---------------------

«отлично»	«зачтено»	Обучающийся верно ответил на 90 – 100 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«хорошо»		Обучающийся верно ответил на 80 – 89 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«удовлетворительно»		Обучающийся верно ответил на 70 – 79 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Обучающийся верно ответил на 69 % и менее тестовых заданий при прохождении тестирования

Критерии и шкалы оценивания результатов обучения при проведении текущего контроля успеваемости

Собеседование

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Глубокое и прочное усвоение программного материала. Полные, последовательные, грамотные и логически излагаемые ответы при видоизменении задания. Обучающийся свободно справляется с поставленными задачами, может обосновать принятые решения, демонстрирует владение разносторонними навыками и приемами выполнения практических работ
«хорошо»		Знание программного материала, грамотное изложение, без существенных неточностей в ответе на вопрос, правильное применение теоретических знаний, владение необходимыми навыками при выполнении практических задач
«удовлетворительно»		Обучающийся демонстрирует усвоение основного материала, при ответе допускаются неточности, при ответе недостаточно правильные формулировки, нарушение последовательности в изложении программного материала, затруднения в выполнении практических заданий Слабое знание программного материала, при ответе возникают ошибки, затруднения при выполнении практических работ
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Не было попытки выполнить задание

Разноуровневые задачи (задания)

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Демонстрирует очень высокий/высокий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«хорошо»		Демонстрирует достаточно высокий/выше среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«удовлетворительно»		Демонстрирует средний уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Большинство требований, предъявляемых к заданию, выполнены. Демонстрирует низкий/ниже среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Многие требования, предъявляемые к заданию, не выполнены
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Демонстрирует очень низкий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Не ответа.

Творческое задание

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Представленная работа демонстрирует точное понимание задания и полное ему соответствие. В работе приводятся конкретные факты и примеры. Материал изложен логично. Работа и форма её представления является авторской, выполнена самостоятельно и содержит большое число оригинальных, изобретательных примеров. Эффективное использование изображений, видео, аудио и других мультимедийных возможностей, чтобы представить свою тему и

		вызвать интерес. Презентация имеет все необходимые разделы, данные об авторе, ссылки на источники, оформлена в одном стиле. Текст не избыточен на слайде, не имеет орфографических и речевых ошибок
«хорошо»		Представленная работа демонстрирует понимание задания. В работу включаются как материалы, имеющие как непосредственное отношение к теме, так и материалы, не имеющие отношения к ней. Содержание работы соответствует заданию, но не все аспекты задания раскрыты. В работе есть элементы творчества. Используются однотипные мультимедийные возможности, или некоторые из них отвлекают внимание от темы презентации. Основные требования к презентации соблюдены, но отсутствует выполнение требований либо к оформлению, либо к содержанию. Текст на слайде не избыточен, но плохо читается, несколько неудачных речевых выражений
«удовлетворительно»		В работу включена собранная обучающимся информация, но она не анализируется и не оценивается. Нарушение логики в изложении материала. Обычная, стандартная работа, элементы творчества отсутствуют. Не используются изображения, видео, аудио и другие мультимедийные возможности, или их использование отвлекает внимание. Не соблюдены требования к оформлению презентации. Слишком много текста, или две и более орфографических ошибок, или речевые и орфографические ошибки
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Включены материалы, не имеющие непосредственного отношения к теме работы, содержание работы не относится в рассматриваемой проблеме. Отсутствует логики в изложении материала. Не используются изображения, видео, аудио и другие мультимедийные возможности, или их использование отвлекает внимание. Не соблюдены требования к оформлению презентации

3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

3.1 Типовые контрольные задания для проведения собеседования

Контрольные варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для проведения собеседований.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 1. Влияние рисков на деятельность организации»

- 1 Проявление рисков в деятельности организации
- 2 Владельцы и носители рисков в деятельности организации
- 3 Факторы рисков
- 4 Влияния рисков на деятельность организации
- 5 Последствия реализации рисков в деятельности организации

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 2. Этапы управления рисками. Уровни управления рисками»

- 1 Этапы управления рисками в организации
- 2 Идентификация рисков. Описание рисков.
- 3 Контроль и мониторинг в процессе управления рисками
- 4 Обработка информации, собранной в процессе контроля и мониторинга
- 5 Уровни управления рисками

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 5. Методические основы управления рисками»

- 1 Организационные особенности процесса управления рисками
- 2 Организационные особенности системы управления рисками
- 3 Методы управления рисками
- 4 Принятие рисков как метод управления
- 5 Отказ от рисков как метод управления
- 6 Снижение рисков как метод управления
- 7 Передача рисков как метод управления

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 7. Политика в области управления рисками»

- 1 Сущность политики в области управления рисками
- 2 Элементы политики управления рисками
- 3 Этапы разработки политики управления рисками
- 4 Согласование политики управления рисками с другими политиками организации
- 5 Оценка эффективности политики управления рисками

3.2 Типовые контрольные задания для решения разноуровневых задач (заданий)

Контрольные варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для решения разноуровневых задач.

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 1. Влияние рисков на деятельность организации»

Задание: На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ (контрольных работ в случае заочной формы обучения), представить проявление и возможное влияние наиболее распространенных рисков на деятельность организации. Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей.

Вид деятельности	Наиболее распространенные риски	Проявление риска	Возможное влияние рисков на деятельность организации в случае их реализации
Операционная	Технико-технологический
	Организационно-управленческий
	Юридический (правовой)
	Коммерческий
	Конкурентный
	Логистический
	Техногенный
	Природный
	Социальный
Финансовая	Макроэкономический
	Кредитный
	Риск балансовой ликвидности
	Валютный риск
Инвестиционная	Процентный риск
	Инфляционный
	Риск рыночной ликвидности
	Имущественный

Образец заданий для решения разноуровневых задач
«Тема 2. Этапы управления рисками. Уровни управления рисками»

Задание:

На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ (контрольных работ в случае заочной формы обучения), представить сущность этапов управления рисками с учетом осуществления типовых бизнес-процессов. Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей.

Бизнес-процесс	Сущность бизнес-процесса (осуществляемые операции и центры ответственности)	Этап управления рисками	Сущность процесса реализации этапа управления рисками
1. Основные бизнес-процессы			
Снабжение ресурсами	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...
		Контроль	...
		Мониторинг	...
Производство	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...
		Контроль	...
		Мониторинг	...
Сбыт продукции	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...
		Контроль	...
		Мониторинг	...
Расчеты с покупателями	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...
		Контроль	...
		Мониторинг	...
Расчеты с поставщиками	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...
		Контроль	...
		Мониторинг	...
2. Обеспечивающие бизнес-процессы			
Управление персоналом	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...
		Контроль	...
		Мониторинг	...
Бухгалтерский и налоговый учет	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...

		Контроль	...
		Мониторинг	...
3. Бизнес-процессы управления			
Принятие управленческих решений	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...
		Контроль	...
		Мониторинг	...
4. Бизнес-процессы развития			
Стратегия развития	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...
		Контроль	...
		Мониторинг	...
Инвестиционная стратегия	Идентификация	...
		Оценка	...
		Анализ	...
		Выбор метода и способа управления	...
		Контроль	...
		Мониторинг	...

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 3. Теоретические и методологические основы оценки рисков»

Задание: На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, определить наиболее целесообразную методику оценки риска.

Риск	Методика оценки	Входящая информация	Информация о риске в результате оценки
Технико-технологический
Организационно-управленческий
Юридический (правовой)
Коммерческий
Конкурентный
Логистический
Техногенный
Геологоразведочный
Репутационный
Маркетинговый
Информационный
Природный
Социальный
Макроэкономический
Кредитный
Риск балансовой ликвидности
Валютный риск
Процентный риск
Инфляционный
Риск рыночной ликвидности
Имущественный

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 4. Качественная и количественная оценка рисков»

Задание: На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, осуществить анализ основных рисков организации.

Оценка и анализ риска рыночной ликвидности

Показатель	
Стоимость актива, находящего под риском	
Риск актива (стандартное отклонение)	
Значение нормального стандартного распределения при уровне вероятности 95%	
Значение нормального стандартного распределения при уровне вероятности 99%	
Стоимость под риском (VaR) при 95% вероятности	
Стоимость под риском (VaR) при 99% вероятности	
Математическое ожидание котируемого спреда по анализируемому активу	
Стоимость под риском с учетом фактора ликвидности (LVaR) при 95% вероятности	
Стоимость под риском с учетом фактора ликвидности (LVaR) при 99% вероятности	

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 6. Виды способов и инструментов управления рисками»

На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ (контрольных работ в случае заочной формы обучения), и ранее идентифицированных и описанных рисков:

- 1 Определить для каждого риска наиболее подходящие методы управления рисками
- 2 Для каждого выбранного метода определить наиболее подходящие способы управления рисками
- 3 При возможности для каждого указанного способа определить инструмент управления рисками
- 4 По каждому риску сделать заключение о возможности трансформации структурных характеристик риска

Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей (можно добавить нужные или удалить ненужные риски)

Риск	Методы управления	Способы управления	Инструменты управления	Влияние управления на уровень риска
Технико-технологический	
Организационно-управленческий	
Юридический (правовой)	
Коммерческий	
Конкурентный	
Логистический	
Техногенный	
Геологоразведочный	
Репутационный	
Маркетинговый	
Информационный	
Природный	
Социальный	
Макроэкономический	
Кредитный	
Риск балансовой ликвидности	
Валютный риск	
Процентный риск	
Инфляционный	
Риск рыночной ликвидности	
Имущественный	

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 8. Проектирование и внедрение системы управления рисками»

Задание: На основании особенностей деятельности организации, состояния внешней и внутренней среды, а также информации, полученной в ходе выполнения предыдущих практических работ и заданий, необходимо:

- оценить организационные возможности для внедрения системы управления рисками в организации
- представить и описать основные элементы системы управления рисками в соответствии с особенностями деятельности организации
- дать характеристику основным этапам проектирования и внедрения системы управления рисками в организации
- представить показатели (могут быть как качественные, так и количественные), по которым возможно будет осуществить оценку эффективности системы управления рисками

3.3 Типовые контрольные задания для выполнения творческих заданий

Контрольные варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для выполнения творческих заданий.

Образец творческого задания

«Тема 7. Политика в области управления рисками»

Задание: На основании особенностей деятельности организации, состояния внешней и внутренней среды, а также информации, полученной в ходе выполнения предыдущих практических работ и заданий, необходимо:

- определить основные элементы политики организации в области управления рисками
- разработать политику организации в области управления рисками
- описать функции подразделений в реализации политики в области управления рисками

3.4 Типовые контрольные задания для проведения тестирования

Фонд тестовых заданий по дисциплине содержит тестовые задания, распределенные по разделам и темам, с указанием их количества и типа.

Структура фонда тестовых заданий по дисциплине

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД	Характеристика ТЗ	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
ПК-6.4.1	Тема 1. Влияние рисков на деятельность организации	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-6.4.1	Тема 2. Этапы управления рисками. Уровни управления рисками	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-6.4.1	Тема 3. Теоретические и методологические основы оценки рисков	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-6.4.1	Тема 4. Качественная и количественная оценка рисков	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ

		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-6.4.2	Тема 5. Методические основы управления рисками	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-6.4.2	Тема 6. Виды способов и инструментов управления рисками	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-6.4.2	Тема 7. Политика в области управления рисками	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-6.4.2	Тема 8. Проектирование и внедрение системы управления рисками	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Итого	72 – ОТЗ 48 – ЗТЗ

Полный комплект ФТЗ хранится в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС и обучающийся имеет возможность ознакомиться с демонстрационным вариантом ФТЗ.

Ниже приведен образец типового варианта итогового теста, предусмотренного рабочей программой дисциплины.

Образец типового варианта итогового теста,
предусмотренного рабочей программой дисциплины

1 Для анализа рыночных рисков более всего подходит

А метод анализа «стоимости под риском»

Б метод анализа факторов риска

В метод анализа чувствительности

2 Для анализа рисков реального инвестирования более всего подходят

А метод анализа стоимости под риском

Б метод анализа чувствительности

В метод «дерево событий»

3 Для анализа кредитных рисков более всего подходят

А метод актуарных моделей

Б метод анализа «стоимости под риском»

В метод анализа по модели Мертона

4 Для анализа рисков балансовой ликвидности более всего подходит

А метод анализа коэффициентов деятельности

Б метод анализа премии за риск

В метод анализа факторов риска

5 Для анализа рисков портфельного инвестирования более всего подходят *анализ доходности и волатильности*

6 Для анализа рыночного риска с учетом фактора риска используется

А нормализованный спрэд

Б котируемый спрэд

В реализованный спрэд

7 Для анализа рыночного риска инвестиционного портфеля при помощи модели VaR более всего подходит *параметрический метод*

8 Для анализа спреда оценивается его зависимость от

А количества сделок, объема сделок, рыночной цены

Б количества сделок, объема сделок, доходности ценной бумаги

В количества сделок, объема сделок, волатильности ценной бумаги

9 Мерой риска инвестиционного портфеля является *стандартное отклонение*

10 Причиной риска является *неопределенность*

11 Источником риска является

А неблагоприятные условия деятельности

Б неопределенность

В неблагоприятное событие

Г неправильное управленческое решение

12 В зависимости от сферы возникновения риски бывают

А внешними и внутренними

Б чистыми и спекулятивными

В частными и общими

13 В зависимости от вида деятельности риски бывают

А коммерческими и рыночными

Б операционными, финансовыми и инвестиционными

В отраслевые и индивидуальные

14 Эмитенты финансовых инструментов как агенты организации при анализе факторов риска относятся к *финансовой деятельности*

15 Проблемы с возвратом дебиторской задолженности становятся причиной более консервативной маркетинговой стратегии. Эта модель характеризует переход *риска ликвидности в рыночный риск*

16 Мера риска инвестиционного портфеля, как правило, рассчитывается за *последний календарный год*

17 Запас финансовой прочности инвестиционного проекта при помощи анализа чувствительности рассчитывается относительно *рыночных рисков*

18 Конкуренты как агенты организации при анализе факторов риска относятся к *операционной деятельности*

3.5 Перечень теоретических вопросов к зачету

(для оценки знаний)

1. Понятие и сущность рисков организации
2. Причина, источники и факторы рисков
3. Виды рисков. классификация рисков
4. Влияние рисков на деятельность организации
5. Этапы управления рисками
6. Уровни управления рисками
7. Внешняя среда как основной источник рисков
8. Внутренняя среда как источник рисков
9. Организационные, финансовые и другие возможности управления рисками
10. Идентификация рисков
11. Описание рисков
12. Реестр рисков

13. Подходы к оценке рисков
14. Качественный подход к оценке рисков
15. Количественный подход к оценке рисков
16. Методики качественной оценки рисков
17. Методики количественной оценки рисков
18. Информация, необходимая для оценки рисков
19. Структурирование информации, полученной в ходе оценки рисков
20. Карта рисков

3.6 Перечень типовых простых практических заданий к зачету

(для оценки умений)

1 Представьте порядок идентификации рисков. Дайте характеристику каждому этапу. Опишите роль идентификации в процессе управления рисками.

2 Дайте характеристику информации, необходимой для оценки рисков деятельности организации. Каким образом обрабатывается информация, используемая для оценки рисков?

3 Дайте характеристику методике оценки рисков «Метод галстук-бабочка». Какая информация необходима для применения данного метода? Какая информация будет в распоряжении на выходе?

3.7 Перечень типовых практических заданий к зачету

(для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1 Рассчитайте риск для инвестора с учетом фактора ликвидности при владении финансовым инструментом. В собственности инвестора находится 168 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 334 руб. Волатильность финансового инструмента за последний отчетный период составляла 0,0038. Математическое ожидание котированного спреда по данному инструменту составляет 0,4940. Значение нормального стандартного распределения определяется для вероятности в 95%.

2 Определите расстояние до точки дефолта. Рыночная стоимость активов организации составляет 9568 тыс. руб., волатильность стоимость рыночных активов в течение года составляет 0,050. Предположительный темп роста активов составляет 0,7. Краткосрочные обязательства организации составляют 2988 тыс. руб., долгосрочные обязательства составляют 3168 тыс. руб.

3 Рассчитайте стоимость под риском для финансового инструмента инвестора на срок 8 день (дня, дней). В собственности инвестора находится 121 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 984 руб. Волатильность финансового инструмента за период составила 0,024. Значение нормального стандартного распределения определяется при уровне вероятности в 99%.

3.8 Перечень теоретических вопросов к экзамену

(для оценки знаний)

1. Понятие и сущность рисков организации
2. Причина, источники и факторы рисков
3. Виды рисков. классификация рисков
4. Влияние рисков на деятельность организации
5. Этапы управления рисками
6. Уровни управления рисками
7. Внешняя среда как основной источник рисков
8. Внутренняя среда как источник рисков
9. Организационные, финансовые и другие возможности управления рисками
10. Идентификация рисков

11. Описание рисков
12. Реестр рисков
13. Подходы к оценке рисков
14. Качественный подход к оценке рисков
15. Количественный подход к оценке рисков
16. Методики качественной оценки рисков
17. Методики количественной оценки рисков
18. Информация, необходимая для оценки рисков
19. Структурирование информации, полученной в ходе оценки рисков
20. Карта рисков
21. Корректировка реестра и карты рисков
22. Методы управления рисками
23. Способы и инструменты обработки рисков
24. Способы и инструменты отказа от риска
25. Способы и инструменты принятия риска
26. Способы и инструменты снижения риска
27. Способы и инструменты передачи риска
28. Выявление наиболее оптимальных способов управления рисками
29. Обоснование эффективности используемых способов и инструментов управления рисками
30. Комплексная программа страхования в управлении рисками
31. Управление рисками операционной деятельности
32. Управление рисками финансовой деятельности
33. Управление рисками инвестиционной деятельности
34. Система управления рисками
35. Организационные особенности интегрированной системы управления рисками
36. Признаки эффективного интегрированного риск-менеджмента
37. Проектирование интегрированной системы риск-менеджмента
38. Этапы проектирования интегрированной системы риск-менеджмента
39. Оценка эффективности интегрированной системы риск-менеджмента
40. Политика управления рисками

3.9 Перечень типовых простых практических заданий к экзамену (для оценки умений)

1 В чем заключается сущность метода отказа от рисков как метода управления? Какие достоинства и недостатки данного метода существуют?

2 Для управления какими видами рисков подходит диверсификация как способ управления? Какого эффекта можно добиться в операционной деятельности при использовании данного способа?

3 Дайте характеристику каждому этапу проектирования системы управления рисками. Какие ресурсы организации необходимы для разработки и внедрения системы управления рисками?

3.10 Перечень типовых практических заданий к экзамену (для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1 Рассчитайте премию за риск при инвестировании в ценную бумагу.

Исходные данные:

- доходность финансового рынка за три последних периода: 12,9%, 12,1%, 16,4%;
- безрисковая ставка: 6,7%;
- мера систематического риска акции 0,8.

2 Рассчитайте стоимость под риском для валютного риска организации. У организации имеется задолженность в валюте в размере 8617 долл. Курс доллара составляет 65,2 руб.

Волатильность финансового инструмента за период составила 0,0866. Значение нормального стандартного распределения определяется при уровне вероятности в 95%.

3 Определите уровень технико-технологического риска.

Внеоборотные активы компании составляют 3700 тыс. руб. Финансовые вложения 980 тыс. руб. Производственное оборудование 218 тыс. руб. Станки и технологические установки 742 тыс. руб. Нематериальные активы 725 тыс. руб.

Количество технологических операций, выполняемых организацией за отчетный период, составляет 141. Количество сбоев в производственном процессе за отчетный период составляет

4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

В таблице приведены описания процедур проведения контрольно-оценочных мероприятий и процедур оценивания результатов обучения с помощью оценочных средств в соответствии с рабочей программой дисциплины.

Наименование оценочного средства	Описания процедуры проведения контрольно-оценочного мероприятия и процедуры оценивания результатов обучения
Собеседование	Собеседование, предусмотренное рабочей программой дисциплины, проводится на практическом занятии. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся тему, вопросы для подготовки к собеседованию. Результаты собеседования преподаватель доводит до обучающихся сразу после завершения собеседования
Разноуровневая задача (задание)	Выполнение разноуровневых задач (заданий), предусмотренных рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Во время выполнения задач (заданий) разрешается пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий
Творческое задание	Творческие задания выдаются на практических занятиях, предшествующих изучению предлагаемой темы. Задания выложены в электронной информационно-образовательной среде ИргУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет. Индивидуальные задания должны быть выполнены в установленный преподавателем срок и в соответствии с требованиями к оформлению (текстовой и графической частей), сформулированными в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль» (в последней редакции). Выполненные задания в назначенный срок сдаются на проверку

Для организации и проведения промежуточной аттестации составляются 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.

Перечень теоретических вопросов и типовые практические задания разного уровня сложности для проведения промежуточной аттестации обучающиеся получают в начале семестра через электронную информационно-образовательную среду ИргУПС (личный кабинет обучающегося).

Описание процедур проведения промежуточной аттестации в форме зачета и оценивания результатов обучения

При проведении промежуточной аттестации в форме зачета преподаватель может воспользоваться результатами текущего контроля успеваемости в течение семестра. С целью использования результатов текущего контроля успеваемости, преподаватель подсчитывает среднюю оценку уровня сформированности компетенций обучающегося (сумма оценок, полученных обучающимся, делится на число оценок).

Шкала и критерии оценивания уровня сформированности компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета по результатам текущего контроля (без дополнительного аттестационного испытания)

Средняя оценка уровня сформированности компетенций по результатам текущего контроля	Шкала оценивания
Оценка не менее 3,0 и нет ни одной неудовлетворительной оценки по текущему контролю	«зачтено»
Оценка менее 3,0 или получена хотя бы одна неудовлетворительная оценка по текущему контролю	«не зачтено»

Если оценка уровня сформированности компетенций обучающегося не соответствует критериям получения зачета без дополнительного аттестационного испытания, то промежуточная аттестация проводится в форме собеседования по перечню теоретических вопросов и типовых практических задач или в форме компьютерного тестирования.

Промежуточная аттестация в форме зачета с проведением аттестационного испытания проходит на последнем занятии по дисциплине.

При проведении промежуточной аттестации в форме компьютерного тестирования вариант тестового задания формируется из фонда тестовых заданий по дисциплине случайным образом, но с условием: 50 % заданий должны быть заданиями открытого типа и 50 % заданий – закрытого типа.

Описание процедур проведения промежуточной аттестации в форме экзамена и оценивания результатов обучения

Промежуточная аттестация в форме экзамена проводится путем устного собеседования по билетам или в форме компьютерного тестирования.

При проведении промежуточной аттестации в форме собеседования билеты составляются таким образом, чтобы каждый из них включал в себя теоретические вопросы и практические задания.

Билет содержит: два теоретических вопроса для оценки знаний. Теоретические вопросы выбираются из перечня вопросов к экзамену; два практических задания: одно из них для оценки умений (выбирается из перечня типовых простых практических заданий к экзамену); другое практическое задание для оценки навыков и (или) опыта деятельности (выбираются из перечня типовых практических заданий к экзамену).

Распределение теоретических вопросов и практических заданий по экзаменационным билетам находится в закрытом для обучающихся доступе. Разработанный комплект билетов (25-30 билетов) не выставляется в электронную информационно-образовательную среду ИрГУПС, а хранится на кафедре-разработчике фондов оценочных средств.

На экзамене обучающийся берет билет, для подготовки ответа на экзаменационный билет обучающемуся отводится время в пределах 45 минут. В процессе ответа обучающегося на вопросы и задания билета, преподаватель может задавать дополнительные вопросы.

Каждый вопрос/задание билета оценивается по четырехбалльной системе, а далее вычисляется среднее арифметическое оценок, полученных за каждый вопрос/задание. Среднее арифметическое оценок округляется до целого по правилам округления.

При проведении промежуточной аттестации в форме компьютерного тестирования вариант тестового задания формируется из фонда тестовых заданий по дисциплине случайным образом, но с условием: 50 % заданий должны быть заданиями открытого типа и 50 % заданий – закрытого типа.

Образец экзаменационного билета

	Экзаменационный билет № 1 по дисциплине «Управление рисками»	Утверждаю: Заведующий кафедрой «_____» ИрГУПС _____
1. Идентификация рисков как этап управления рисками 2. Методики количественной оценки рисков 3. Рассчитайте стоимость под риск для валютного риска организации. У организации имеется задолженность в валюте в размере 8617 долл. Курс доллара составляет 65,2 руб. Волатильность финансового инструмента за период составила 0,0866. Значение нормального стандартного распределения определяется при уровне вероятности в 95%. 4. Рассчитайте риск для инвестора с учетом фактора ликвидности при владении финансовым инструментом. В собственности инвестора находится 168 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 334 руб. Волатильность финансового инструмента за последний отчетный период составляла 0,0038. Математическое ожидание котированного спреда по данному инструменту составляет 0,4940. Значение нормального стандартного распределения определяется для вероятности в 95%.		