

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА

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

УТВЕРЖДЕНА  
приказом и.о. ректора  
от «17» июня 2022 г. № 77

**Б1.О.52 Проектирование систем управления рисками  
хозяйствующих субъектов**

**рабочая программа дисциплины**

Специальность/направление подготовки – 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация/профиль – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Квалификация выпускника – Экономист

Форма и срок обучения – очная форма 5 лет; заочная форма 6 лет

Кафедра-разработчик программы – Финансовый и стратегический менеджмент

Общая трудоемкость в з.е. – 5

Часов по учебному плану (УП) – 180

В том числе в форме практической подготовки (ПП) – 4/4

(очная/заочная)

Формы промежуточной аттестации

очная форма обучения:

экзамен 9 семестр, курсовая работа 9 семестр

заочная форма обучения:

экзамен 6 курс, курсовая работа 6 курс

**Очная форма обучения**

**Распределение часов дисциплины по семестрам**

Семестр	9	Итого
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП
<b>Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*</b>	68/4	<b>68/4</b>
– лекции	34	<b>34</b>
– практические (семинарские)	34/4	<b>34/4</b>
– лабораторные		
<b>Самостоятельная работа</b>	76	<b>76</b>
<b>Экзамен</b>	36	<b>36</b>
<b>Итого</b>	<b>180/4</b>	<b>180/4</b>

**Заочная форма обучения**

**Распределение часов дисциплины по семестрам**

Курс	6	Итого
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП
<b>Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*</b>	16/4	<b>16/4</b>
– лекции	8	<b>8</b>
– практические (семинарские)	8/4	<b>8/4</b>
– лабораторные		
<b>Самостоятельная работа</b>	146	<b>146</b>
<b>Экзамен</b>	18	<b>18</b>
<b>Итого</b>	<b>180/4</b>	<b>180/4</b>

\* В форме ПП – в форме практической подготовки.

ИРКУТСК

Электронный документ выгружен из ЕИС ФГБОУ ВО ИРГУПС и соответствует оригиналу

Подписант ФГБОУ ВО ИРГУПС Трофимов Ю.А.

00a73c5b7b623a969ccad43a81ab346d50 с 08.12.2022 14:32 по 02.03.2024 14:32 GMT+03:00

Подпись соответствует файлу документа



Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – специалитет по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, утвержденным Приказом Минобрнауки России от 14.04.2021 г. № 293.

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 «17» июня 2022 г. № 10

Зав. кафедрой, к.э.н., доцент

С.А. Халетская

<b>1 ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
<b>1.1 Цель дисциплины</b>	
1	формирование умений и навыков в области проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов для обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов
<b>1.2 Задачи дисциплины</b>	
1	сформировать знания в области системного подхода в управлении рисками;
2	сформировать навыки в области анализа информации, необходимой для проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов в системе экономической безопасности;
3	сформировать навыки интерпретации экономических показателей в процессе проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов в системе экономической безопасности
<b>1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины</b>	
Профессионально-трудовое воспитание обучающихся	
Цель профессионально-трудового воспитания – формирование у обучающихся осознанной профессиональной ориентации, понимания общественного смысла труда и значимости его для себя лично, ответственного, сознательного и творческого отношения к будущей деятельности, профессиональной этики, способности предвидеть изменения, которые могут возникнуть в профессиональной деятельности, и умению работать в изменённых, вновь созданных условиях труда.	
Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:	
– формирование сознательного отношения к выбранной профессии;	
– воспитание чести, гордости, любви к профессии, сознательного отношения к профессиональному долгу, понимаемому как личная ответственность и обязанность;	
– формирование психологии профессионала;	
– формирование профессиональной культуры, этики профессионального общения;	
– формирование социальной компетентности и другие задачи, связанные с имиджем профессии и авторитетом транспортной отрасли	

<b>2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП</b>	
Блок/часть ОПОП	Блок 1. Дисциплины / Обязательная часть
<b>2.1 Дисциплины и практики, на которых основывается изучение данной дисциплины</b>	
1	Б1.О.30 Страхование
2	Б1.О.37 Теоретические основы обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов
3	Б1.О.43 Оценка и управление рисками
4	Б1.О.49 Система обеспечения экономической безопасности
5	Б1.О.50 Управление финансовыми рисками в системе обеспечения экономической безопасности
6	Б1.В.ДВ.06.01 Экономическая безопасность в цифровой экономике
<b>2.2 Дисциплины и практики, для которых изучение данной дисциплины необходимо как предшествующее</b>	
1	Б2.О.05(П) Производственная - практика по профилю профессиональной деятельности (организационно-управленческая)
2	Б2.О.06(Пд) Производственная - преддипломная практика
3	Б3.01(Д) Подготовка к процедуре защиты выпускной квалификационной работы
4	Б3.02(Д) Защита выпускной квалификационной работы

<b>3 ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ТРЕБОВАНИЯМИ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ</b>		
Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения
ПК-5 Способен разрабатывать системы управления рисками и обеспечения экономической безопасности с учетом бизнес-процессов хозяйствующих субъектов	ПК-5.1 Разрабатывает системы управления рисками с учетом бизнес-процессов хозяйствующих субъектов	Знать: элементы систем управления рисками хозяйствующих субъектов; принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов; виды и особенности бизнес-процессов хозяйствующих субъектов в рамках проектирования систем управления
		Уметь: планировать процесс проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов; учитывать особенности бизнес-процессов и деятельности хозяйствующих субъектов при проектировании систем управления рисками; проектировать систему управления рисками хозяйствующих субъектов
		Владеть: общей методологией анализа деятельности хозяйствующих субъектов в целях проектирования систем

		управления рисками; навыками проектирования систем управления рисками с учетом бизнес-процессов хозяйствующего субъекта; навыками оценки эффективности проектируемых систем управления рисками с учетом бизнес-процессов хозяйствующих субъектов
ПК-6 Способен организовывать процессы управления рисками и нивелирования угроз экономической безопасности с целью внедрения систем управления рисками и обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов	ПК-6.1 Обосновывает выбор способов и инструментов управления различными видами рисков	Знать: критерии выбора способов и инструментов воздействия на риск в системе управления рисками; методическую базу систем управления рисками хозяйствующих субъектов
		Уметь: оценивать внешнюю среду хозяйствующего субъекта в целях обоснования способов воздействия на риск в системе управления рисками; систематизировать информацию о деятельности хозяйствующего субъекта в целях обоснования способов воздействия на риск в системе управления рисками; осуществлять мониторинг системы управления рисками хозяйствующих субъектов с целью совершенствования ее дальнейшего функционирования
		Владеть: навыками анализа информации о деятельности организации для обоснования используемых способов и инструментов воздействия на риск в системе управления рисками; навыками интерпретации собранной в процессе мониторинга информации о функционировании системы управления рисками с целью ее дальнейшего улучшения

#### 4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма					Заочная форма					*Код индикатора достижения компетенции
		Семестр	Часы				Курс	Часы				
			Лек	Пр	Лаб	СР		Лек	Пр	Лаб	СР	
<b>1.0</b>	<b>Раздел 1. Теоретические основы функционирования систем управления рисками.</b>											
1.1	Тема 1. Сущность системы управления рисками	9	4	4	6	6/уст.	1	1		15	ПК-5.1	
1.2	Тема 2. Адаптивный, комплексный и интегрированный риск-менеджмент	9	4	4	6	6/уст.	1	1		18	ПК-5.1	
<b>2.0</b>	<b>Раздел 2. Методические аспекты проектирования систем управления рисками.</b>											
2.1	Тема 3. Принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	9	4	4	6	6/уст.	1	1		15	ПК-5.1	
2.2	Тема 4. Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса. Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков	9	8	8/2	8	6/уст.	2	2/2		22	ПК-5.1	
2.3	Тема 6. Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов	9	10	10/2	8	6/уст.	2	2/2		25	ПК-6.1	

#### 4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма				Заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции		
		Семестр	Часы			Курс	Часы					
			Лек	Пр	Лаб		СР	Лек	Пр		Лаб	СР
2.4	Тема 7. Разработка политики управления рисками	9	4	4		6	6/уст.	1	1		15	ПК-5.1
	Форма промежуточной аттестации – экзамен	9	36				6/зимняя	18				ПК-5.1 ПК-6.1
	Курсовая работа	9				36	6/зимняя				36	ПК-5.1 ПК-6.1
	Итого часов (без учёта часов на промежуточную аттестацию)		34	34/4		76		8	8/4		146	

#### 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	Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник / Г. Д. Антонов, О. П. Иванова, В. М. Тумин ; рецензенты : Р. М. Качалов, П. П. Табурчак. Москва : ИНФРА-М, 2020. - 153с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://new.znaniium.com/catalog/document?id=346774">https://new.znaniium.com/catalog/document?id=346774</a>	Онлайн
6.1.1.2	Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник - 2-е изд. пер. и доп. В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. Москва : Юрайт, 2022. - 365с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://urait.ru/bcode/489098">https://urait.ru/bcode/489098</a> (дата обращения: 09.09.2022)	Онлайн
6.1.1.3	Панарина, М. М. Корпоративная безопасность: система управления рисками и комплаенс в компании : учебное пособие для вузов / М. М. Панарина. Москва : Юрайт, 2022. - 158с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://urait.ru/bcode/497632">https://urait.ru/bcode/497632</a> (дата обращения: 09.09.2022)	Онлайн

##### 6.1.2 Дополнительная литература

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.2.1	Авдийский, В. И. Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учебное пособие / В. И. Авдийский, В. М. Безденежных, А. В. Дадалко, В. В. Земсков ; под общей редакцией А. В. Дадалко. Москва : ИНФРА-М, 2022. - 203с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://znaniium.com/catalog/product/1863267">https://znaniium.com/catalog/product/1863267</a>	Онлайн
6.1.2.2	Афонин, П. Н. Система управления рисками : учебное пособие / П. Н. Афонин. Санкт-Петербург : Троицкий мост, 2016. - 125с. - Текст: электронный. - URL: <a href="https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=445276">https://biblioclub.ru/index.php?page=book&amp;id=445276</a> (дата обращения: 14.09.2022)	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.О.52 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, специализация Экономика-правовое обеспечение экономической безопасности / Л.С. Бородавко ; ИрГУПС. – Иркутск : ИрГУПС, 2023. – 14 с. - Текст:	Онлайн

	электронный. - URL: <a href="https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_4480_1562_2022_1_signed.pdf">https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_4480_1562_2022_1_signed.pdf</a>
<b>6.2 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»</b>	
6.2.1	Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» — <a href="https://cyberleninka.ru/">https://cyberleninka.ru/</a>
6.2.2	Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU — <a href="https://elibrary.ru/">https://elibrary.ru/</a>
6.2.3	Электронно-библиотечная система «Образовательная платформа ЮПАЙТ», <a href="https://urait.ru/">https://urait.ru/</a>
<b>6.3 Программное обеспечение и информационные справочные системы</b>	
<b>6.3.1 Базовое программное обеспечение</b>	
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 <a href="http://free-software.com.ua/pdf-viewer/foxit-reader/">http://free-software.com.ua/pdf-viewer/foxit-reader/</a>
6.3.1.4	Adobe Acrobat Reader DC свободно распространяемое программное обеспечение <a href="https://get.adobe.com/ru/reader/enterprise/">https://get.adobe.com/ru/reader/enterprise/</a>
6.3.1.5	Яндекс. Браузер. Прикладное программное обеспечение общего назначения, Офисные приложения, лицензия – свободно распространяемое программное обеспечение по лицензии BSD License
<b>6.3.2 Специализированное программное обеспечение</b>	
6.3.2.1	Не предусмотрено
<b>6.3.3 Информационные справочные системы</b>	
6.3.3.1	Не предусмотрены
<b>6.4 Правовые и нормативные документы</b>	
6.4.1	Не предусмотрены

<b>7 ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ</b>	
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-316 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
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. Основное оборудование: специализированная мебель, мультимедиапроектор, экран, компьютер. Для проведения занятий имеются учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты).
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

<b>8 МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
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 помечать вопросы, выделенные обучающимся для консультации с преподавателем. Выводы, полученные в виде формул, рекомендуется в конспекте подчеркивать или обводить рамкой,</p>

	<p>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>
<p>Практическое занятие</p>	<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>
<p>Самостоятельная работа</p>	<p>Обучение по дисциплине «Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов» 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 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 «Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов» участвует в формировании компетенций:

ПК-5. Способен разрабатывать системы управления рисками и обеспечения экономической безопасности с учетом бизнес-процессов хозяйствующих субъектов

ПК-6. Способен организовывать процессы управления рисками и нивелирования угроз экономической безопасности с целью внедрения систем управления рисками и обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов

#### Программа контрольно-оценочных мероприятий очная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
<b>9 семестр</b>				
<b>1.0</b>	<b>Раздел 1. Теоретические основы функционирования систем управления рисками</b>			
1.1	Текущий контроль	Тема 1. Сущность системы управления рисками	ПК-5.1	Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Тема 2. Адаптивный, комплексный и интегрированный риск-менеджмент	ПК-5.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
<b>2.0</b>	<b>Раздел 2. Методические аспекты проектирования систем управления рисками</b>			
2.1	Текущий контроль	Тема 3. Принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	ПК-5.1	Собеседование (устно)
2.2	Текущий контроль	Тема 4. Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса. Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков	ПК-5.1	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.3	Текущий контроль	Тема 6. Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов	ПК-6.1	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.4	Текущий контроль	Тема 7. Разработка политики управления рисками	ПК-5.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Теоретические основы функционирования систем управления рисками Раздел 2. Методические аспекты проектирования систем управления рисками	ПК-5.1 ПК-6.1	Курсовая работа (письменно) Курсовая работа (устно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Теоретические основы функционирования систем управления рисками Раздел 2. Методические аспекты проектирования систем управления рисками	ПК-5.1 ПК-6.1	Экзамен (собеседование) Экзамен - тестирование (компьютерные технологии)

#### Программа контрольно-оценочных мероприятий заочная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
<b>6 курс, сессия установочная</b>				

<b>1.0</b>	<b>Раздел 1. Теоретические основы функционирования систем управления рисками.</b>			
1.1	Текущий контроль	Тема 1. Сущность системы управления рисками	ПК-5.1	Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Тема 2. Адаптивный, комплексный и интегрированный риск-менеджмент	ПК-5.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
<b>2.0</b>	<b>Раздел 2. Методические аспекты проектирования систем управления рисками.</b>			
2.1	Текущий контроль	Тема 3. Принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	ПК-5.1	Собеседование (устно)
2.2	Текущий контроль	Тема 4. Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса. Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков	ПК-5.1	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.3	Текущий контроль	Тема 6. Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов	ПК-6.1	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.4	Текущий контроль	Тема 7. Разработка политики управления рисками	ПК-5.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
<b>6 курс, сессия зимняя</b>				
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Теоретические основы функционирования систем управления рисками Раздел 2. Методические аспекты проектирования систем управления рисками	ПК-5.1 ПК-6.1	Курсовая работа (письменно) Курсовая работа (устно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Теоретические основы функционирования систем управления рисками Раздел 2. Методические аспекты проектирования систем управления рисками	ПК-5.1 ПК-6.1	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

### Промежуточная аттестация

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	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
2	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
3	Курсовая работа	Позволяет оценить умения обучающихся самостоятельно конструировать свои знания в процессе решения практических задач и проблем, ориентироваться в информационном пространстве и уровень сформированности аналитических, исследовательских навыков, навыков практического и творческого мышления. Может выполняться в индивидуальном порядке или группой обучающихся. Может быть использовано для оценки умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся в предметной или межпредметной областях	Образец задания для выполнения курсовой работы и примерный перечень вопросов для ее защиты

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

Шкала оценивания	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенции
«отлично»	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»	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 экзамена**

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

**Курсовая работа**

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	Содержание курсовой работы полностью соответствует заданию. Представлены результаты обзора литературных и иных источников. Структура курсовой работы логически и методически выдержана. Все выводы и предложения убедительно аргументированы. Оформление курсовой работы и полученные результаты полностью отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. При защите курсовой работы обучающийся правильно и уверенно отвечает на вопросы преподавателя, демонстрирует глубокое знание теоретического материала, способен аргументировать собственные утверждения и выводы
«хорошо»	Содержание курсовой работы полностью соответствует заданию. Представлены результаты обзора литературных и иных источников. Структура курсовой работы логически и методически выдержана. Большинство выводов и предложений аргументировано. Оформление курсовой работы и полученные результаты в целом

	отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. Имеются одна-две несущественные ошибки в использовании терминов, в построенных диаграммах и схемах. Наличествует незначительное количество грамматических и/или стилистических ошибок. При защите курсовой работы обучающийся правильно и уверенно отвечает на большинство вопросов преподавателя, демонстрирует хорошее знание теоретического материала, но не всегда способен аргументировать собственные утверждения и выводы. При наводящих вопросах преподавателя исправляет ошибки в ответе
«удовлетворительно»	Содержание курсовой работы частично не соответствует заданию. Результаты обзора литературных и иных источников представлены недостаточно полно. Есть нарушения в логике изложения материала. Аргументация выводов и предложений слабая или отсутствует. Имеются одно-два существенных отклонений от требований в оформлении курсовой работы. Полученные результаты в целом отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. Имеются одна-две существенных ошибки в использовании терминов, в построенных диаграммах и схемах. Много грамматических и/или стилистических ошибок. При защите курсовой работы обучающийся допускает грубые ошибки при ответах на вопросы преподавателя и /или не дал ответ более чем на 30% вопросов, демонстрирует слабое знание теоретического материала, в большинстве случаев не способен уверенно аргументировать собственные утверждения и выводы
«неудовлетворительно»	Содержание курсовой работы в целом не соответствует заданию. Имеются более двух существенных отклонений от требований в оформлении курсовой работы. Большое количество существенных ошибок по сути работы, много грамматических и стилистических ошибок и др. Полученные результаты не отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. При защите курсовой работы обучающийся демонстрирует слабое понимание программного материала. Курсовая работа не представлена преподавателю. Обучающийся не явился на защиту курсовой работы

### **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.

### **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. Сущность системы управления рисками»

1. Сущность системы управления рисками в организации.
2. Отличия системы управления рисками от процесса управления рисками.
3. Элементы системы управления рисками организации.
4. Принципы системы управления рисками организации.
5. Задачи системы управления рисками организации.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 2. Адаптивный, комплексный и интегрированный риск-менеджмент»

1. Сущность риск-менеджмента как науки.
2. Сущность риск-менеджмента как направления деятельности хозяйствующих субъектов.
3. Адаптивный риск-менеджмент.
4. Комплексный риск-менеджмент.
5. Интегрированный риск-менеджмент.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 3. Принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов»

1. Принципы проектирования систем управления рисками.
2. Этапы проектирования систем управления рисками.
3. Анализ внешней и внутренней среды для проектирования систем управления рисками.
4. Информационная составляющая проектирования систем управления рисками.
5. Документооборот проектирования систем управления рисками

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 4. Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса. Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков»

1. Стейкхолдеры бизнеса.
2. Ценности стейкхолдеров.
3. Финансовая устойчивость и стабильность денежного потока как ценность стейкхолдеров.
4. Агентские конфликты как ценность стейкхолдеров.
5. Деловая активность как ценность стейкхолдеров

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Тема 6. Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов»

1. Необходимость учета бизнес-процессов при проектировании систем управления рисками.
2. Идентификация рисков с учетом бизнес-процессов.
3. Центры ответственности в бизнес-процессах при проектировании систем управления рисками.
4. Обоснование методов, способов и инструментов управления рисками с учетом бизнес-процессов.
5. Оценка влияния рисков на бизнес-процессы

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования  
«Тема 7. Разработка политики управления рисками»

1. Сущность политики управления рисками.
2. Принципы разработки политики управления рисками.
3. Этапы разработки политики управления рисками.
4. Информация, необходимая для разработки политики управления рисками.
5. Необходимость учета особенностей организации при разработке 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 2. Адаптивный, комплексный и интегрированный риск-менеджмент»

Задание. На основании данных о деятельности исследуемой организации (финансовая отчетность, годовые отчеты, аналитическая информация) определить тип риск-менеджмента, который функционирует в организации. Определить элементы конкретного вида риск-менеджмента, а также области деятельности, где они применяются.

Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей. После заполнения аналитической таблицы необходимо сформировать аргументированные выводы.

Вид риск-менеджмента	Элементы риск-менеджмента	Виды деятельности, где они используются
Интегрированный риск-менеджмент		
Комплексный риск-менеджмент		
Адаптивный риск-менеджмент		

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 4. Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса. Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков»

Задание На основании данных о деятельности выбранной для выполнения курсовой работы организации (использовать финансовую отчетность, годовые корпоративные отчеты, информацию официального сайта, любую аналитическую информацию) проанализировать риски стейкхолдеров:

Стейкхолдеры	Ценности, подверженные риску					
	Финансовая устойчивость	Денежный поток	Нематериальные активы	Деловые отношения	Физическая безопасность	Эффективный менеджмент
Акционеры						
Кредиторы						
Поставщики						
Покупатели						
Персонал						



Государство						
Страховщики						
Конкуренты						

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 6. Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов»

Задание. На основании данных о деятельности организации, а также анализа ее деятельности, необходимо представить основные бизнес-процессы.

Основные бизнес-процессы деятельности ПАО «...»

Бизнес-процесс	Сущность бизнес-процесса	Результат реализации бизнес-процесса	Сотрудник, отвечающий за бизнес-процесс
1			
2			
3			
4			

Задание На основании данных о деятельности организации, а также анализа ее деятельности, необходимо представить основные бизнес-процессы и их взаимосвязь с рисками.

Взаимосвязь бизнес-процессов деятельности ПАО «...» и рисков

Бизнес-процесс	Сущность бизнес-процесса	Риски в данном бизнес-процессе	Негативное влияние риска в случае реализации
1		1 риск	
		...	
...		1 риск	
		...	

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 7. Разработка политики управления рисками»

Задание. Необходимо составить политику управления рисками (по основным параметрам и характеристикам).

Как правило, в политику управления рисками включаются следующие положения:

- цель и задачи системы управления рисками
- принципы управления рисками
- классификация рисков
- элементы системы управления рисками
- процессы управления рисками
- организационная структура управления рисками
- структура нормативной документации по управлению рисками

**3.3 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-5.1	Тема 1. Сущность системы управления рисками	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ

		действие	
ПК-5.1	Тема 2. Адаптивный, комплексный и интегрированный риск-менеджмент	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-5.1	Тема 3. Принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-5.1	Тема 4. Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса. Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-6.1	Тема 6. Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
ПК-5.1	Тема 7. Разработка политики управления рисками	Знание	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 2 – ЗТЗ
		Итого	63 – ОТЗ 42 – 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. Интегрированный риск-менеджмент – это:**

А) система управления рисками хозяйствующего субъекта на основе их комплексного восприятия,

Б) система управления рисками хозяйствующего субъекта на основе включения рисков составляющей в управление всеми бизнес-процессами компании,

В) система быстрого реагирования на возникающие локальные экономические угрозы.

**2. Система принятия рисков в целях максимизации положительных экономических эффектов – это синдика**

**3. Управление ресурсами с точки зрения интегрированного риск-менеджмента должно включать:**

А) направление ресурсов на систему превентивного управления рисками,

Б) направление ресурсов на систему адаптивного управления рисками

**4. Рассчитайте экономическую добавленную стоимость бизнеса.** Доходность инвестированного капитала составляет 14%, средневзвешенная стоимость капитала 9%, собственный капитал 230 млн. руб., заемный капитал 410 млн. руб.

**5. Рассчитайте добавленную стоимость акционерного капитала.** На начало периода размер акционерного капитала составлял 420 млн. руб., на конец года его размер составлял 439 млн. руб.

**6. Оптимальный коэффициент хеджирования позволяет проанализировать:**

А) возможности применения тех или иных инструментов хеджирования для управления рисками,

Б) оптимальную долю захеджированных рисков,

В) оптимальное количество срочных сделок, необходимых для хеджирования рисков.

**7. Какой показатель следует выбрать для анализа эффективности методов управления рыночными (внешними) рисками публичной компании: акционерная добавленная стоимость**

**8. Возникновение нового риска в результате усложнения имеющихся рисков, - это мутация рисков.**

**9. Авария на производстве требует вложения дополнительных средств в материальные оборотные активы. Эта модель характеризует переход: технико-технологического риска в риск ликвидности**

**10. Сокращение персонала в целях минимизации фонда оплаты труда – это модель перехода: риска ликвидности в организационно-управленческий риск**

**11. Рост цен на закупаемое сырье приводит к трудностям с погашением кредиторской задолженности и снижению уровня обеспеченности финансового цикла материальными запасами. Эта модель характеризует переход: рыночного риска в риск ликвидности**

**12. Система управления рисками хозяйствующих субъектов по отношению к бизнес-процессам**

А) является частью бизнес-процессов хозяйствующих субъектов

Б) является самостоятельным бизнес-процессом хозяйствующих субъектов

**13. Анализ системы управления рисками в рамках бизнес-процессов хозяйствующего субъекта позволяет**

А) выявить взаимосвязь системы управления рисками с системой управления всей организации

Б) выявить взаимосвязь проявления рискованных ситуаций с деятельностью организации

**14. В каком случае компании следует выбрать в качестве алгоритма управления риском один из методов уменьшения возможного ущерба?**

А) когда размер возможного ущерба превышает математическое ожидание полезного эффекта от принятия риска,

Б) когда не представляется возможным устранить все факторы неопределенности,

В) когда затраты на внедрение систем трансформации риска превышают затраты на финансирование его последствий.

**15. Какие методы применяются при формировании системы управления рисками ликвидности:**

А) физическая удаленность опасных объектов,

Б) внедрение системы бюджетирования,

В) ограничение полномочий руководителя.

**16. Приоритетной моделью комплексного управления рисками является:**

А) управление возможностями получения положительных результатов от контролируемого принятия риска,

Б) минимизация потерь и сохранение стоимости бизнеса.

**17. Для оценки возможности применения инструментов хеджирования систематических рисков необходимо проанализировать связь между следующими показателями:**

А) стоимость бизнеса и операционная прибыль,

Б) стоимость бизнеса и динамика процентных ставок,

В) операционная прибыль и динамика инфляции

**18. К показателям, необходимым для проведения анализа результативности системы управления рисками, можно отнести:** *акционерную добавленную стоимость, прибавочную стоимость*

### 3.4 Типовое задание для выполнения курсовой работы

Типовые задания выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведен образец задания для выполнения курсовой работы и примерный перечень вопросов для ее защиты.

#### Образец типового задания для выполнения курсовой работы

На основании данных о деятельности выбранной организации обучающийся должен осуществить следующие аналитические процедуры:

1. Анализ деятельности объекта исследования. Данное задание включает в себя анализ основных видов деятельности, объемных показателей (физические показатели деятельности, выручка, чистая прибыль, капитализация и т.д.), структуры собственников и принципов взаимодействия с ними, рынков и географических сегментов присутствия.

2. Анализ профиля рисков объекта исследования.

В первую очередь, осуществляется анализ угроз для стейкхолдеров объекта исследования. Для этого необходимо описать основных стейкхолдеров организации, дать характеристику их взаимосвязи. Стейкхолдером признается любое лицо, материально заинтересованное в успешной деятельности хозяйствующего субъекта. Принято считать, что практика перенесения всех рисков на ключевых стейкхолдеров в долгосрочном периоде может привести к банкротству, поэтому важным аспектом анализа систем управления рисками является оценка степени ответственности компании за риски своих ключевых контрагентов. На основании данных о деятельности организации представить основные угрозы для ценностей стейкхолдеров.

Матрица рисков стейкхолдеров ПАО «...»

Стейкхолдеры	Ценности, подверженные риску					
	Финансовая устойчивость	Денежный поток	Нематериальные активы	Деловые отношения	Физическая безопасность	Эффективный менеджмент
Акционеры						
Кредиторы						
Поставщики						
Покупатели						
Персонал						
Государство						
Страховщики						
Конкуренты						

Затем, на основании проведенного анализа представить риски деятельности объекта исследования. Сначала должен быть указан наиболее полный перечень рисков деятельности объекта исследования, а затем выделены основные риски. обязательно представить аргументацию для выделения именно указанных рисков. Для удобства необходимо сделать матрицу рисков, чтобы получить более полное представление.

Матрица основных рисков деятельности ПАО «...»

Первичный риск	Вторичный риск			
	1 риск	2 риск	3 риск	...
1 риск				
2 риск				
...				

Следующим этапом является изучение выявленных и проанализированных рисков в контексте бизнес-процессов объекта исследования. В самом общем виде бизнес-процесс представляет из себя логическую последовательность действий, нацеленных на получение определенного результата. Анализ бизнес-процессов деятельности позволяет выявить основные риски, возникающие и воздействующие на различные сферы функционирования организации. Данный анализ позволяет представить более полную картину рисков деятельности организации.

#### Основные бизнес-процессы деятельности ПАО «...»

Бизнес-процесс	Сущность бизнес-процесса	Результат реализации бизнес-процесса	Сотрудник, отвечающий за бизнес-процесс
1			
2			
3			
4			

#### Взаимосвязь бизнес-процессов деятельности ПАО «...» и рисков

Бизнес-процесс	Сущность бизнес-процесса	Риски в данном бизнес-процессе	Негативное влияние риска в случае реализации
1		1 риск	
		...	
...		1 риск	
		...	

### 3. Анализ стратегических преимуществ в области управления рисками

Затем необходимо осуществить анализ стратегических преимуществ, необходимых для управления рисками.

Обучающийся должен проанализировать деятельность объекта исследования с целью выявления наличия перечисленных преимуществ. Результаты следует обобщить в таблице.

#### Анализ стратегических преимуществ ПАО «...» для управления рисками

Преимущество	Анализ наличия преимуществ в объекте исследования
Наличие информационных преимуществ	
Наличие организационных и технических ресурсов позволяющие гибко реагировать на негативные рисковые ситуации	
Наличие опыта и знаний в рисковом сегменте	
Наличие капитала, его диверсифицированная структура и возможность привлечения дополнительных средств	
Наличие реальных опционов	

Для заполнения таблицы необходимо представить данные о структуре капитала и возможности привлечения дополнительных ресурсов (данные можно взять из ранее выполненных работ по другим дисциплинам).

Здесь же необходимо представить зависимость деятельности организации от общеэкономического состояния страны.

Оценивается регрессионная зависимость совокупной стоимости бизнеса и уровня операционной прибыли от следующих факторов:

- валютного курса;
- уровня инфляции;
- динамики ВВП;

- среднего уровня процентной ставки.

Могут быть использованы другие факторы.

Обучающиеся должны проанализировать регрессионные зависимости прибыли и стоимости бизнеса от перечисленных факторов для того, чтобы оценить степень влияния на результаты деятельности объекта исследования соответственно валютных, рыночных, циклических и финансовых рисков.

В результате проведенного анализа следует сделать вывод о том, есть ли у компании возможности по эффективному управлению рисками.

#### 4. Проектирование системы управления рисками

В первую очередь необходимо представить мероприятия по управлению рисками стейкхолдеров.

На основании приведенной расширенной матрицы стейкхолдеров (получателей) риска (2 глава) необходимо проанализировать мероприятия, которые реализует объект исследования для снижения перечисленных в ячейках таблицы факторов риска.

Основной мотив управления состоит в том, что рост рисков внешней и внутренней среды компании влечет за собой цепную реакцию и, в данном случае, перенос риска на ключевых стейкхолдеров носит лишь кратковременный характер, а в долгосрочной перспективе, повышает вероятность банкротства путем высокой отдачи негативных обратных связей.

В связи с этим ключевые корпорации разрабатывают систему управления рисками с позиции учета интересов ключевых стейкхолдеров. Конкретные мероприятия программ управления рисками зависят от отрасли, используемых источников капитала и зависимости от внешней среды.

В матрицу включены, главным образом, общественные факторы риска, поскольку именно в них можно распознать корпоративные особенности в финансировании и трансформации рисков.

Обучающиеся должны составить следующую таблицу для анализа эффективности управления рисками стейкхолдеров объекта исследования

#### Управление рисками стейкхолдеров ПАО «...»

Стейкхолдер	Ценности, подверженные риску	Мероприятия, направленные на сокращение риска стейкхолдера

После таблицы должен быть сделан вывод по результатам анализа. Вывод должен заключаться в оценке уровня ответственности объекта исследования в части управления рисками.

Следующим этапом является анализ используемых методов и способов управления основными рисками организации.

Необходимо дать характеристику представляемым методам и способам.

#### Используемые методы и способы управления рисками ПАО «...»

Риск и возможные потери от реализации данного риска	Методы трансформации риска	Методы финансирования риска
Описание конкретных рисков, свойственных хозяйствующему субъекту. В обязательном порядке анализируются рыночные риски, риски ликвидности, кредитные риски, технико-технологические риски, организационно-управленческие риски	Описание методов, направленных на снижение частоты возникновения ущербов или на снижение суммы ущерба	Описание ситуаций, в которых трансформация рисков экономически нецелесообразна, риски принимаются, а их последствия финансируются в случае реализации конкретного рискового события

Затем необходимо составить политику управления рисками (по основным параметрам и характеристикам).

Как правило, в политику управления рисками включаются следующие положения:

- цель и задачи системы управления рисками
- принципы управления рисками
- классификация рисков
- элементы системы управления рисками
- процессы управления рисками
- организационная структура управления рисками
- структура нормативной документации по управлению рисками

После выполнения всей работы необходимо формировать заключение.

Общий вывод должен базироваться на результатах проведенного анализа и включать оценку максимально угрожающих росту и развитию компании рисков, а также системе мер противодействия им, принятой в организации. Кроме того, общие выводы должны содержать предложения обучающегося по сокращению уровня риска, его трансформации и финансированию.

Образец типовых вопросов для защиты курсовых работ

1. Какова роль систем управления рисками в современном бизнесе?
2. Какие основные цели и задачи системы управления рисками в хозяйствующих субъектах?
3. Какие стратегии управления рисками существуют?
4. Какие основные инструменты управления рисками могут быть использованы?
5. Каким образом система управления рисками влияет на финансовую устойчивость организации?
6. Как можно оценить эффективность системы управления рисками?
7. Какие методы мониторинга и контроля рисков могут быть использованы в организации?
8. Как система управления рисками влияет на процесс принятия решений в организации?
9. Какие технологии и информационные системы могут поддерживать систему управления рисками?
10. Как система управления рисками может быть адаптирована к специфике отрасли?
11. Как система управления рисками может повлиять на репутацию компании?
12. Как система управления рисками может быть интегрирована в стратегическое планирование организации?
13. Как система управления рисками может быть связана с стратегическими планами организации?
14. Каким образом управление рисками влияет на цикличность бизнеса?
15. Как система управления рисками может способствовать улучшению управления бизнес-процессами?

### **3.5 Перечень теоретических вопросов к экзамену**

(для оценки знаний)

1. Сущность адаптивного риск-менеджмента.
2. Сущность комплексного риск-менеджмента.
3. Сущность интегрированного риск-менеджмента. Преимущества системного управления рисками в организации.
4. Практическая направленность моделей и методов интегрированного риск-менеджмента.
5. Характер неопределенности и моделирование систем управления рисками: общие принципы.
6. Факторы риска и модели системного риск-менеджмента.
7. Функции интегрированного риск-менеджмента.
8. Рисковая среда и экономическая безопасность хозяйствующего субъекта.

9. Затраты на реализацию функций интегрированного управления рисками. Экономический эффект от затрат на системы управления рисками.
  10. Показатели, характеризующие эффективность системы управления рисками.
  11. Анализ эффективности систем управления рисками с точки зрения стоимостного подхода.
  12. Методы и модели трансформации риска.
  13. Методы и модели финансирования риска.
  14. Стратегии управления финансовыми рисками.
  15. Стратегии управления технико-технологическими рисками.
  16. Стратегии управления организационными рисками.
  17. Общий подход к организации системы управления рисками: описание матрицы «Человек – система – сила разрушений – источники финансирования»
  18. Стейкхолдеры бизнеса. Ключевые риски взаимодействия.
  19. Обоснование необходимости управления рисками стейкхолдеров бизнеса. Управление рисками стейкхолдеров для сохранения стратегических ресурсов компании.
  20. Система управления рисками персонала.
  21. Организационно-управленческие риски. Анализ цены ошибки управленческого персонала.
  22. Психологическая природа риска.
  23. Система управления технико-технологическими рисками на различных уровнях разрушений.
  24. Физический уровень технико-технологических рисков.
  25. Технический уровень технико-технологических рисков.
  26. Функциональный уровень технико-технологических рисков.
  27. Общий подход к управлению финансовыми рисками.
  28. Парадокс Боумана. Требования к системе, способной принимать финансовые риски.
  29. Особенности применения хеджирования рисков. Анализ оптимального хеджа.
- Затраты на хеджирование и экономический эффект от хеджирования.

### **3.6 Перечень типовых простых практических заданий к экзамену** (для оценки умений)

1. Перечислите этапы проектирования системы управления рисками с указанием информации о деятельности организации, необходимой для принятия управленческих решений в этой области. Отрадите типовые особенности деятельности организации, которые влияют на формирование системы управления рисками.
2. Перечислите основные положения политики управления рисками. представьте особенности деятельности организации, которые должны найти отражение в политике управления рисками
3. Перечислите основные этапы проектирования системы управления рисками согласно процессному подходу проектирования. Представьте особенности процессного подхода проектирования систем управления рисками в зависимости от отрасли деятельности организации.

### **3.7 Перечень типовых практических заданий к экзамену** (для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1. Определите основные риски деятельности организации в сфере фармацевтического производства. Представьте возможные направления мутации данных рисков.
2. Определите основные бизнес-процессы и сопутствующие им риски деятельности организации в сфере разработки программного обеспечения с указанием влияния этих рисков на результаты реализации данных бизнес-процессов.
3. Определите основные риски стейкхолдеров организации, занимающейся поставками высокотехнологического оборудования из-за рубежа.



#### 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
Курсовая работа	Ход выполнения разделов курсовой работы в рамках текущего контроля оценивается преподавателем исходя из объемов выполненных работ в соответствие со шкалами оценивания. Преподаватель информирует обучающихся о результатах оценивания выполнения курсового проекта сразу после контрольно-оценочного мероприятия. В ходе защиты курсовой работы обучающийся делает доклад протяженностью 5 – 7 минут. Преподаватель ставит окончательную оценку за курсовую работу после завершения защиты, учитывая уровень ее защиты

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 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

 <p>ИрГУПС 20__-20__ учебный год</p>	<p align="center"><b>Экзаменационный билет № 1</b> <b>по дисциплине «<u>Проектирование систем</u></b> <b><u>управления рисками хозяйствующих субъектов</u>»</b></p>	<p align="center">Утверждаю: Заведующий кафедрой « _____ » ИрГУПС _____</p>
<p>1. Характер неопределенности и моделирование систем управления рисками: общие принципы.</p> <p>2. Обоснование необходимости управления рисками стейкхолдеров бизнеса. Управление рисками стейкхолдеров для сохранения стратегических ресурсов компании</p> <p>3. 2. Определите основные бизнес-процессы и сопутствующие им риски деятельности организации в сфере разработки программного обеспечения с указанием влияния этих рисков на результаты реализации данных бизнес-процессов.</p> <p>4. Перечислите основные положения политики управления рисками. представьте особенности деятельности организации, которые должны найти отражение в политике управления рисками</p>		