

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.В.ДВ.05.02 Инструменты риск-менеджмента

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 – 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

(очно-заочная)

Формы промежуточной аттестации

очно-заочная форма обучения:

зачет 2 семестр, экзамен 3 семестр

Очно-заочная форма обучения	Распределение часов дисциплины по семестрам			
	Семестр	2	3	Итого
Вид занятий	Часов по УП	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 «17» июня 2022 г. № 10

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 интегрированной системы риск-менеджмента в соответствии со стратегическими целями организации
1.2 Задачи дисциплины	
1	сформировать у обучающихся представление о разработке и функционировании системы риск-менеджмента;
2	сформировать у обучающихся основы владения подходами и моделями оценки и анализа рисков в рамках функционирования системы риск-менеджмента

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	Б1.В.ДВ.05.01 Управление рисками
2	Б2.О.04(П) Производственная - организационно-управленческая практика
3	Б3.01(Д) Подготовка к процедуре защиты выпускной квалификационной работы
4	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: элементы системы риск-менеджмента; основные методы и модели оценки рисков деятельности организаций (предприятий)
		Уметь: систематизировать и анализировать информацию о деятельности организации (предприятия) для разработки и совершенствования системы риск-менеджмента; осуществлять оценку и анализ рисков деятельности организации (предприятия) с использованием различных математических и статистических моделей
	ПК-6.4.2 Разрабатывает и обосновывает нормативное обеспечение и содержание мероприятий по предотвращению и снижению рисков	Владеть: навыками интерпретации результатов оценки рисков деятельности организаций (предприятий) в рамках функционирования системы риск-менеджмента; навыками координации деятельности организации (предприятия) в рамках функционирования системы риск-менеджмента
		Знать: нормативное обеспечение системы риск-менеджмента; методы, способы и инструменты воздействия на риски, реализуемых в рамках системы риск-менеджмента
		Уметь: осуществлять обоснованный выбор способов и инструментов воздействия на риски в рамках реализации системы риск-менеджмента
		Владеть: навыками оценки эффективности применяемых методов и способов воздействия на риски в системе риск-менеджмента

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ							
Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Семестр	Очно-заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции
			Часы				
			Лек	Пр	Лаб	СР	
1.0	Раздел 1. Теоретические основы риск-менеджмента.						
1.1	Тема 1. Сущность риск-менеджмента	2	3	3		18	ПК-6.4.2
1.2	Тема 2. Элементы и инструменты риск-менеджмента	2	4	4		18	ПК-6.4.2

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ							
Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Семестр	Очно-заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции
			Часы				
			Лек	Пр	Лаб	СР	
2.0	Раздел 2. Оценка рисков в системе риск-менеджмента.						
2.1	Тема 3. Идентификация рисков	2	2	2/2		20	ПК-6.4.1
2.2	Тема 4. Оценка и анализ рисков	2	6	6/2		20	ПК-6.4.2
	Форма промежуточной аттестации – зачет	2	9				ПК-6.4.1 ПК-6.4.2
3.0	Раздел 3. Инструменты обработки рисков в системе риск-менеджмента.						
3.1	Тема 5. Основы применения инструментов обработки рисков	3	3	3		20	ПК-6.4.2
3.2	Тема 6. Разработка и реализация мероприятий по управлению рисками	3	6	6/4		20	ПК-6.4.2
4.0	Раздел 4. Внедрение системы риск-менеджмента.						
4.1	Тема 7. Проектирование интегрированной системы риск-менеджмента	3	3	3		20	ПК-6.4.2
4.2	Тема 8. Внедрение интегрированной системы риск-менеджмента	3	3	3		20	ПК-6.4.2
	Форма промежуточной аттестации – экзамен	3	27				ПК-6.4.1 ПК-6.4.2
	Итого часов (без учёта часов на промежуточную аттестацию)		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	Бурцева, Т. А. Моделирование и управление рисками : учебное пособие / Т. А. Бурцева. Москва : РТУ МИРЭА, 2020. - 131с. - Текст: электронный. - URL: https://e.lanbook.com/book/171446 (дата обращения: 19.04.2023)	Онлайн
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
6.1.1.3	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
6.1.2 Дополнительная литература		
	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.2.1	Асламова, В.С. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учебное пособие / рец.: Л. В. Массель, А. В. Бальчугов. Иркутск : ИрГУПС, 2017. - 176с. - Текст: электронный. - URL: https://umcздт.ru/books/1319/264241/	Онлайн
6.1.2.2	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 ; рецензенты : Н. Н. Пилипенко, Н. С. Перекалина.	Онлайн

	Москва : Дашков и К°, 2021. - 418с. - Текст: электронный. - URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=684196	
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.05.02 Инструменты риск-менеджмента по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, профиль Экономико-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_5020_1519_2022_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-210 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-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
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>
Лабораторная работа	<p>Основной целью лабораторных работ является теоретическое обоснование, наглядное и/или экспериментальное подтверждение и/или проверка существенных теоретических положений (законов, закономерностей) анализ существующих методик и методов их реализации и т.д. Они занимают преимущественное место при изучении дисциплин обязательной части и части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1.</p> <p>Исходя из цели, содержанием лабораторных работ могут быть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - экспериментальная проверка формул, методик расчета; - проведение натурных измерений свойств, рабочих параметров, режимов работы при помощи лабораторного оборудования и/или стендов и макетов; - ознакомление, анализ и теоретические выкладки по устройству, принципу действия и способам обслуживания аппаратов, деталей машин, механизмов, процессов, протекающих в них при этом и т.д.; - наглядная графическая интерпретация чертежей, схем, объемных поверхностей и т.д., воспроизводимых с помощью специализированного программного обеспечения; - имитационное моделирование процессов, протекающих в сложных химических, физических, механических, электрических и пр. объектах; - наглядное представление о работе персонала конкретной организации или подразделения ОАО «РЖД» посредством моделирования штатных и внештатных ситуаций в виртуальных специализированных АРМ (автоматизированных рабочих мест); - установление и подтверждение закономерностей (путем сравнения проведенного эксперимента и рассчитанных значений) и т.д.; - ознакомление с методиками проведения экспериментов, наглядным устройством стенд-макетов и пр.; - установление свойств веществ, их качественных и количественных характеристик; - анализ различных характеристик процессов, в том числе производственных и иных процессов; - расчет параметров различных явлений и процессов, смоделировать которые не возможно в реальных условиях (например, чрезвычайные ситуации и пр.);

	<p>- наблюдение развития явлений, процессов и др. Допускается иное содержание лабораторных работ, если это будет способствовать реализации целей и задач дисциплины и формированию соответствующих компетенций. По характеру выполняемых лабораторных работ возможны:</p> <ul style="list-style-type: none"> - ознакомительные работы, используемые для закрепления изученного теоретического материалы; - аналитические работы, используемые для получения новой информации на основе формализованных методов; - творческие работы, ориентированные на самостоятельный выбор подходов решения задач. <p>Прежде, чем приступить к лабораторным занятиям, обучающимся необходимо повторить теоретический материал по теме работы. Каждая лабораторная работа оснащена методическими указаниями, разработанными преподавателями, ведущими дисциплину</p>
Самостоятельная работа	<p>Обучение по дисциплине «Инструменты риск-менеджмента» 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>
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	

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 «Инструменты риск-менеджмента» 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 очно-заочная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
2 семестр				
1.0	Раздел 1. Теоретические основы риск-менеджмента			
1.1	Текущий контроль	Тема 1. Сущность риск-менеджмента	ПК-6.4.2	Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Тема 2. Элементы и инструменты риск-менеджмента	ПК-6.4.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
2.0	Раздел 2. Оценка рисков в системе риск-менеджмента			
2.1	Текущий контроль	Тема 3. Идентификация рисков	ПК-6.4.1	В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.2	Текущий контроль	Тема 4. Оценка и анализ рисков	ПК-6.4.2	В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Теоретические основы риск-менеджмента Раздел 2. Оценка рисков в системе риск-менеджмента	ПК-6.4.1 ПК-6.4.2	Зачет (собеседование) Зачет - тестирование (компьютерные технологии)
3 семестр				
3.0	Раздел 3. Инструменты обработки рисков в системе риск-менеджмента			
3.1	Текущий контроль	Тема 5. Основы применения инструментов обработки рисков	ПК-6.4.2	Собеседование (устно)
3.2	Текущий контроль	Тема 6. Разработка и реализация мероприятий по управлению рисками	ПК-6.4.2	В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
4.0	Раздел 4. Внедрение системы риск-менеджмента			
4.1	Текущий контроль	Тема 7. Проектирование интегрированной системы риск-менеджмента	ПК-6.4.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
4.2	Текущий контроль	Тема 8. Внедрение интегрированной системы риск-менеджмента	ПК-6.4.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Теоретические основы риск-менеджмента Раздел 2. Оценка рисков в системе риск-менеджмента Раздел 3. Инструменты обработки рисков в системе риск-менеджмента Раздел 4. Внедрение системы риск-менеджмента	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

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.	Перечень теоретических

		Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	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.

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 риск-менеджмента»

- 1 Понятие и сущность риск-менеджмента
- 2 Роль риск-менеджмента в деятельности организации
- 3 Объекты риск-менеджмента
- 4 Субъекты риск-менеджмента
- 5 Принципы и задачи риск-менеджмента

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 2. Элементы и инструменты риск-менеджмента»

- 1 Процесс риск-менеджмента и система риск-менеджмента
- 2 Этапы процесса риск-менеджмента
- 3 Элементы системы риск-менеджмента
- 4 Инструменты риск-менеджмента
- 5 Планирование риск-менеджмента в организации

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 5. Основы применения инструментов обработки рисков»

- 1 Организационные особенности обработки рисков в организации
- 2 Подходы к обработке рисков
- 3 Аргументация выбора подходящего инструмента обработки рисков
- 4 Планирование мероприятий в рамках обработки рисков
- 5 Обоснование эффективности предложенных мероприятий

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 7. Проектирование интегрированной системы риск-менеджмента»

- 1 Сущность интегрированной системы риск-менеджмента
- 2 Признаки эффективного интегрированного риск-менеджмента
- 3 Этапы проектирования интегрированной системы риск-менеджмента
- 4 Сбор и систематизация информации для проектирования интегрированной системы риск-менеджмента
- 5 Проектирование интегрированной системы риск-менеджмента с учетом бизнес-процессов организации

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 8. Внедрение интегрированной системы риск-менеджмента»

- 1 Внедрение интегрированной системы риск-менеджмента
- 2 Организационные особенности внедрения интегрированной системы риск-менеджмента
- 3 Финансовые особенности внедрения интегрированной системы риск-менеджмента
- 4 Мониторинг функционирования интегрированной системы риск-менеджмента
- 5 Контроль за функционированием интегрированной системы риск-менеджмента

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. Элементы и инструменты риск-менеджмента»

1. На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ (контрольных работ в случае заочной формы обучения), представить взаимосвязь основных элементов риск-менеджмента и деятельности исследуемой организации. Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей.

Элемент риск-менеджмента	Сущность элемента	Область деятельности организации, связанная с функционированием элемента риск-менеджмента	Информация о деятельности организации, необходимая для реализации риск-менеджмента
Контрольная среда
Цель и задачи риск-менеджмента
Анализ внешней среды организации
Анализ внутренней среды организации
Идентификация рисков
Оценка рисков
Стратегия риск-менеджмента
Реализация стратегии риск-менеджмента
Процесс контроля и мониторинга
Информационная среда
Документооборот риск-менеджмента
Центры ответственности в риск-менеджменте

Образец заданий для решения разноуровневых задач
«Тема 3. Идентификация рисков»

Задание:

1. На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ (контрольных работ в случае заочной формы обучения), выделить риски, сопутствующие деятельности, описать их. Для каждого риска определить причину, источники и факторы.

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

Риск	Причина	Источники	Факторы
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. Оценка и анализ рисков»**

На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ (контрольных работ в случае заочной формы обучения), осуществить анализ основных рисков организации.

Для удобства можно воспользоваться аналитическими таблицами

Оценка и анализ процентного риска

Показатель				Интерпретация показателя
Заемный капитал				-
Собственный капитал				-
Рентабельность активов				-
Фактическая процентная ставка				-
ПФР				
ДФР				

Оценка и анализ риска балансовой ликвидности

Показатель			
Коэффициент абсолютной ликвидности			
Коэффициент быстрой ликвидности			
Коэффициент текущей ликвидности			
Оборачиваемость дебиторской задолженности			
Оборачиваемость кредиторской задолженности			
Период оборота дебиторской задолженности			
Период оборота кредиторской задолженности			
Финансовый цикл			

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 6. Разработка и реализация мероприятий по управлению рисками»

Задание: 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 В соответствии с выбранными способами и инструментами управления рисками представить конкретные мероприятия воздействия на риск
- 2 Для каждого мероприятия описать центры ответственности в организации
- 3 Описать возможные изменения в характеристиках рисках в случае реализации предложенных мероприятий

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

Риск	Способ управления	Инструмент управления	Мероприятие	Центр ответственности	Изменение в риске
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 7. Проектирование интегрированной системы риск-менеджмента»

Задание. С учетом особенностей деятельности организации необходимо:

- описать этапы проектирования интегрированной системы риск-менеджмента с учетом отрасли и особенностей деятельности
- определить стратегические преимущества организации в управлении рисками
- описать наиболее целесообразную интегрированную систему риск-менеджмента для организации

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 8. Внедрение интегрированной системы риск-менеджмента»

Задание. С учетом особенностей деятельности организации необходимо:

- описать организационные особенности внедрения интегрированной системы риск-менеджмента с учетом отрасли и особенностей деятельности
- описать финансовые особенности внедрения интегрированной системы риск-менеджмента с учетом отрасли и особенностей деятельности
- описать стратегические преимущества от внедрения интегрированной системы риск-менеджмента с учетом отрасли и особенностей деятельности

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-6.4.2	Тема 1. Сущность риск-менеджмента	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 2. Элементы и инструменты риск-менеджмента	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. Идентификация 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 4. Оценка и анализ 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. Основы применения инструментов обработки 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 6. Разработка и реализация мероприятий по управлению 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. Проектирование интегрированной системы риск-менеджмента	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. Внедрение интегрированной системы риск-менеджмента	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 Источником риска является

А неблагоприятные условия деятельности

Б неопределенность

В неблагоприятное событие

Г неправильное управленческое решение

2 Метод передачи риска относится к стратегии финансирования

3 Стратегический уровень системы управления рисками хозяйствующих субъектов заключается в

А создании условий для возможности корректировки управленческих решений в области управления рисками в соответствии с развивающимися событиями и условиями

Б создании условий для мгновенного реагирования на возникающие рисковые ситуации в деятельности хозяйствующего субъекта

В создании условий для принятия управленческих решений с целью обеспечения длительной устойчивости организации к рисковым ситуациям

4 Оперативный уровень системы управления рисками хозяйствующих субъектов заключается в

А создании условий для возможности корректировки управленческих решений в области управления рисками в соответствии с развивающимися событиями и условиями

Б создании условий для мгновенного реагирования на возникающие рисковые ситуации в деятельности хозяйствующего субъекта

В создании условий для принятия управленческих решений с целью обеспечения длительной устойчивости организации к рисковым ситуациям

5 Процесс управления рисками является

А отдельным направлением деятельности руководства

Б элементом системы управления рисками хозяйствующих субъектов

В самостоятельным элементом деятельности хозяйствующего субъекта

6 Тактический уровень системы управления рисками хозяйствующих субъектов заключается в

А создании условий для возможности корректировки управленческих решений в области управления рисками в соответствии с развивающимися событиями и условиями

Б создании условий для мгновенного реагирования на возникающие рисковые ситуации в деятельности хозяйствующего субъекта

В создании условий для принятия управленческих решений с целью обеспечения длительной устойчивости организации к рисковым ситуациям

7 Метод снижения риска относится к стратегии трансформации

8 Метод отказа от риска относится к стратегии трансформации

9 Диверсификация как способ управления рисками относится к методу снижения

10 Осуществление превентивных мероприятий как способ управления рисками относится к методу снижения

11 Причиной риска является неопределенность

12 Риск-ориентированное бюджетирование как способ управления рисками относится к методу принятия

13 Страхование как способ управления рисками относится к методу передачи

14 Страхование как способ управления рисками подходят для управления

А кредитными рисками

Б валютными рисками

В технико-технологическими рисками

15 Хеджирование как способ управления рисками подходят для управления

А кредитными рисками

Б валютными рисками

В технико-технологическими рисками

16 Показатель, который позволяет оценить уровень риска балансовой ликвидности

А собственный оборотный капитал

Б чистый оборотный капитал

17 Хеджирование как способ управления рисками относится к методу передачи

18 Мера риска инвестиционного портфеля, как правило, рассчитывается за

А последний календарный месяц

Б последние календарные полгода
В последний календарный год

3.4 Перечень теоретических вопросов к зачету (для оценки знаний)

1. Риск и деятельность организации
2. Носители владельцы рисков
3. Факторы рисков в деятельности организации
4. Источники рисков в деятельности организации
5. Угроза как источник потенциально рискованных ситуаций в деятельности организации
6. Банкротство организации как последствия реализации рисков
7. Анализ внешней среды организации в рискованных ситуациях
8. Анализ внутренней среды организации в рискованных ситуациях
9. Адаптивный риск-менеджмент
10. Комплексный риск-менеджмент
11. Интегрированный риск-менеджмент
12. Нормативное обеспечение риск-менеджмента
13. Документы, обеспечивающие нормативное обеспечение риск-менеджмента
14. Информационное обеспечение процесса риск-менеджмента
15. Регламентирующие показатели процесса риск-менеджмента
16. Элементы риск-менеджмента
17. Необходимость соотнесения элементов риск-менеджмента и областей деятельности организации
18. Контрольная среда риск-менеджмента
19. Стратегия риск-менеджмента
20. Центры ответственности в риск-менеджменте
21. Этапы риск-менеджмента
22. Идентификация рисков
23. Оценка и анализ рисков
24. Выбор метода управления рисками
25. Уровни управления рисками
26. Процесс идентификации рисков
27. Описание рисков
28. Источники и факторы рисков
29. Информация, необходимая для идентификации рисков
30. Этапы идентификации рисков

3.5 Перечень типовых простых практических заданий к зачету (для оценки умений)

1 Дайте характеристику каждому элементу системы риск-менеджмента. Какой из элементов является наиболее значимым для обеспечения устойчивости организации в долгосрочной перспективе?

2 Опишите достоинства и недостатки качественного подхода к оценке рисков. Для оценки каких рисков используется качественный подход?

3 Раскройте цель и задачи системы риск-менеджмента в организации. Каким образом стратегические преимущества организации сказываются на деятельности организации?

3.6 Перечень типовых практических заданий к зачету (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%.

3.7 Перечень теоретических вопросов к экзамену (для оценки знаний)

1. Риск и деятельность организации
2. Носители владельцы рисков
3. Факторы рисков в деятельности организации
4. Источники рисков в деятельности организации
5. Угроза как источник потенциально рискованных ситуаций в деятельности организации
6. Банкротство организации как последствия реализации рисков
7. Анализ внешней среды организации в рискованных ситуациях
8. Анализ внутренней среды организации в рискованных ситуациях
9. Адаптивный риск-менеджмент
10. Комплексный риск-менеджмент
11. Интегрированный риск-менеджмент
12. Нормативное обеспечение риск-менеджмента
13. Документы, обеспечивающие нормативное обеспечение риск-менеджмента
14. Информационное обеспечение процесса риск-менеджмента
15. Регламентирующие показатели процесса риск-менеджмента
16. Элементы риск-менеджмента
17. Необходимость соотнесения элементов риск-менеджмента и областей деятельности организации
18. Контрольная среда риск-менеджмента
19. Стратегия риск-менеджмента
20. Центры ответственности в риск-менеджменте
21. Этапы риск-менеджмента
22. Идентификация рисков
23. Оценка и анализ рисков
24. Выбор метода управления рисками
25. Уровни управления рисками
26. Процесс идентификации рисков
27. Описание рисков
28. Источники и факторы рисков
29. Информация, необходимая для идентификации рисков
30. Этапы идентификации рисков
31. Оценка и анализ рисков
32. Информация, используемая для оценки и анализа рисков
33. Структурные характеристики рисков
34. Экспертный подход к оценке рисков
35. Метод Дельфи в оценке рисков
36. Анализ процентного риска
37. Анализ риска балансовой ликвидности
38. Анализ риска рыночной ликвидности
39. Анализ валютного риска
40. Анализ коммерческого риска
41. Анализ технико-технологических рисков

42. Анализ кредитного риска
43. Методы управления рисками
44. Способы и инструменты управления рисками
45. Метод отказа
46. Метод принятия
47. Метод снижения
48. Метод передачи
49. Способы управления метода отказа
50. Способы управления метода принятия
51. Способы управления метода снижения
52. Способы управления метода передачи
53. Обоснование выбора метода и способа управления рисками
54. Мероприятия по управлению рисками
55. Алгоритм разработки мероприятий по управлению рисками
56. Реализация мероприятий по управлению рисками
57. Обоснование затрат на реализацию мероприятий по управлению рисками
58. Определение эффективности процесса управления рисками
59. Показатели оценки эффективности процесса управления рисками
60. Влияние процесса управления рисками на результаты деятельности организации
61. Корректировка процесса управления рисками в условиях изменяющейся среды

3.8 Перечень типовых простых практических заданий к экзамену

(для оценки умений)

1 Идентифицируйте риски для ресторанного бизнеса и приведите наиболее целесообразные способы и инструменты управления ими.

2 Идентифицируйте риски для мебельной фабрики и приведите наиболее целесообразные способы и инструменты управления ими.

3 Идентифицируйте риски для бетонного завода и приведите наиболее целесообразные способы и инструменты управления ими.

3.9 Перечень типовых практических заданий к экзамену

(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 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 43.

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

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

 <p>ИрГУПС 20__-20__ учебный год</p>	<p>Экзаменационный билет № 1 по дисциплине «<u>Инструменты риск-менеджмента</u>»</p>	<p>Утверждаю: Заведующий кафедрой « _____ » ИрГУПС _____</p>
<p>1. Уровни управления рисками 2. Уровни управления рисками 3. Идентифицируйте риски для мебельной фабрики и приведите наиболее целесообразные способы и инструменты управления ими. 4. 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%.</p>		