

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования
"САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
АЭРОКОСМИЧЕСКОГО ПРИБОРОСТРОЕНИЯ"

Кафедра № 82

УТВЕРЖДАЮ

Руководитель направления

д.э.н., проф.

(должность, уч. степень, звание)

В.Б. Сироткин

(инициалы, фамилия)

(подпись)

« 22 » июня 2023 г

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Риск-менеджмент»

(Наименование дисциплины)

Код направления подготовки/ специальности	38.03.02
Наименование направления подготовки/ специальности	Менеджмент
Наименование направленности	Финансовый менеджмент
Форма обучения	заочная

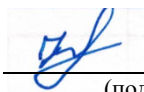
Санкт-Петербург– 2023

Лист согласования рабочей программы дисциплины

Программу составил (а)

доц., к.э.н., доц.

(должность, уч. степень, звание)



17.05.23

(подпись, дата)

Е.М.Лукина

(инициалы, фамилия)

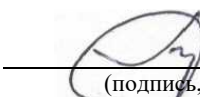
Программа одобрена на заседании кафедры № 82

« 17 » мая 20 23 г, протокол № 10

Заведующий кафедрой № 82

д.э.н., доц.

(уч. степень, звание)



18.05.2023

(подпись, дата)

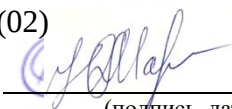
А.С. Будагов

(инициалы, фамилия)

Ответственный за ОП 38.03.02(02)

доц., к.э.н., доц.

(должность, уч. степень, звание)



18.05.23

(подпись, дата)

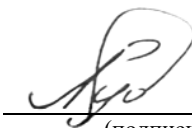
Ю.А. Мартынова

(инициалы, фамилия)

Заместитель директора института №8 по методической работе

доц., к.э.н., доц.

(должность, уч. степень, звание)



18.05.2023

(подпись, дата)

Л.В. Рудакова

(инициалы, фамилия)

Аннотация

Дисциплина «Риск-менеджмент» входит в вариативную часть образовательной программы подготовки обучающихся по направлению 38.03.02 «Менеджмент» направленность «Финансовый менеджмент». Дисциплина реализуется кафедрой №85.

Дисциплина нацелена на формирование у выпускника

общекультурных компетенций:

ОК-3 «способность использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности»,

ОК-6 «способность к самоорганизации и самообразованию»;

профессиональных компетенций:

ПК-11 «владение навыками анализа информации о функционировании системы внутреннего документооборота организации, ведения баз данных по различным показателям и формирования информационного обеспечения участников организационных проектов»,

ПК-15 «умение проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании»,

ПК-16 «владение навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов».

Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с изучением теоретических методов исследований оценивания риска, которые возникают при решении различных задач менеджмента. Особое внимание уделено практическим задачам количественным и логическим методам выявления и оценки риска с использованием современных инструментов менеджмента.

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, лабораторные работы, самостоятельную работу студента,

Программой дисциплины предусмотрены следующие виды контроля: текущий контроль успеваемости, промежуточная аттестация в форме экзамена.

Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 3 зачетных единицы, 108 часов.

Язык обучения по дисциплине «русский».

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

1.1. Цели преподавания дисциплины

Формирование у студентов базовых теоретических знаний и основных практических навыков в области оценки риска и управления им. Студенты за время обучения дисциплине получают знания, позволяющие строить модели управления риском в условиях изменяющейся внешней среды, находить количественную оценку риска возможных мероприятий, принимать управленческие решения с учетом риска.

1.2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения ОП

В результате освоения дисциплины обучающийся должен обладать следующими компетенциями:

ОК-3 «способность использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности»:

знать - теоретические основы оценки риска,

уметь - в соответствии с имеющейся информацией и поставленной задачей выбирать наиболее подходящие приемы для оценки риска,

владеть навыками - использования программных средств для решения практических задач в области риск-менеджмента,

иметь опыт деятельности - решения практических задач для формирования оценок риска;

ОК-6 «способность к самоорганизации и самообразованию»:

знать - основополагающие теоретические работы в области риска,

уметь - формировать модели оценки риска,

владеть навыками - расчета количественных показателей риска,

иметь опыт деятельности - в области оценки риска с использованием программных средств

ПК-11 «владение навыками анализа информации о функционировании системы внутреннего документооборота организации, ведения баз данных по различным показателям и формирования информационного обеспечения участников организационных проектов»:

знать - методы анализа информации о функционировании системы внутреннего документооборота организации,

уметь - вести базы данных по различным показателям,

владеть навыками - формирования информационного обеспечения участников организационных проектов,

иметь опыт деятельности - в сфере информации о функционировании системы внутреннего документооборота организации;

ПК-15 «умение проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании»:

знать - методологии оценки рыночных и специфических рисков,
 уметь - пользоваться программными продуктами при оценке риска для принятия управленческих решений,
 владеть навыками - практической работы с интеллектуальными информационными технологиями при оценке риска,
 иметь опыт деятельности - с технологиями нечеткой логики и нейронных сетей для оценки риска;

ПК-16 «владение навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов»:

знать - методики оценки рисков инвестиционных проектов,
 уметь - выбирать необходимый инструментарий при финансовом планировании и прогнозировании,
 владеть навыками - практических приемов оценки риска в сложных экономических ситуациях,
 иметь опыт деятельности - формирования количественных оценок риска.

2. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина базируется на знаниях, ранее приобретенных обучающимися при изучении следующих дисциплин:

- финансовый менеджмент;
- информационные технологии;

Знания, полученные при изучении материала данной дисциплины, имеют как самостоятельное значение, так и используются при изучении других дисциплин:

- управление изменениями;
- конфликтология.

3. Объем и трудоемкость дисциплины

Данные об общем объеме дисциплины, трудоемкости отдельных видов учебной работы по дисциплине (и распределение этой трудоемкости по семестрам) представлены в таблице 2.

Таблица 1 – Объем и трудоемкость дисциплины

Вид учебной работы	Всего	Трудоемкость по семестрам
		№10
1	2	3
Общая трудоемкость дисциплины, 3Е/(час)	3/ 108	3/ 108
<i>Из них часов практической подготовки</i>	4	4
<i>Аудиторные занятия, всего час., В том числе</i>	16	16

лекции (Л), (час)	8	8
Практические/семинарские занятия (ПЗ), (час)		
лабораторные работы (ЛР), (час)	8	8
курсовой проект (работа) (КП, КР), (час)		
Экзамен, (час)	9	9
Самостоятельная работа , всего	83	83
Вид промежуточного контроля: зачет, дифф. зачет, экзамен (Зачет, Дифф. зач, Экз.)	Экз.	Экз.

4. Содержание дисциплины

- 4.1. Распределение трудоемкости дисциплины по разделам и видам занятий.
Разделы, темы дисциплины и их трудоемкость приведены в таблице 3.

Таблица 3 – Разделы, темы дисциплины, их трудоемкость

Разделы, темы дисциплины	Лекции (час)	ПЗ (СЗ) (час)	ЛР (час)	КП (час)	СРС (час)
Семестр 8					
Раздел 1. Основные понятия «Риск-менеджмента», сущность, содержание и виды рисков	1				3
Раздел 2. Управление рисками в организациях	3		4		40
Раздел 3. Процедуры принятия решений в рискованных ситуациях	4		4		40
Итого в семестре:	8		8		83
Итого	8		8	0	83

Практическая подготовка заключается в непосредственном выполнении обучающимися определенных трудовых функций, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

- 4.2. Содержание разделов и тем лекционных занятий.
Содержание разделов и тем лекционных занятий приведено в таблице 4.

Таблица 4 – Содержание разделов и тем лекционного цикла

Номер раздела	Название и содержание разделов и тем лекционных занятий
Раздел 1.	Основные понятия «Риск-менеджмента», сущность содержание и виды рисков История становления и развития дисциплины. Концепция устойчивого развития. Субъективное и объективное понятия риска. Системный подход к

	управлению риском (УР).. Классификация рисков.
Раздел 2.	Управление рисками в организации Процесс управления рисками в организациях. Структура управления рисками в организациях. Характеристика методов воздействия на риск Методы выявления рисков (опросные листы, структурные диаграммы, карты потоков, анализ финансовой и управленческой отчетности). Методы оценки степени риска: построение деревьев событий и отказов, метод «галстук -бабочка», расчет индекса опасности, оценка ущерба. Количественные методы оценки риска: математическое ожидание. Дисперсия и среднеквадратическое отклонение. VaR (Value at Risk). Полудисперсия. Другие меры риска. Экспертные методы оценки риска: метод Дельфи. Метод сценариев. Мозговой штурм. Интегральная оценка риска. Статистика катастрофических событий.
Раздел 3	Процедуры принятия решений в рискованных ситуациях Построение дерева решений. Моделирование методом Монте-Карло. Байесовский анализ и сеть Байеса . Метод анализа иерархий. Метод аналитических сетей . Построение полей риска.

4.3. Практические (семинарские) занятия
 Темы практических занятий и их трудоемкость приведены в таблице 5.

Таблица 5 – Практические занятия и их трудоемкость

№ п/п	Темы практических занятий	Формы практических занятий	Трудоемкость, (час)	Из них практической подготовки, (час)	№ раздела дисциплины
Учебным планом не предусмотрено					
Всего			10	6	

4.4. Лабораторные занятия
 Темы лабораторных занятий и их трудоемкость приведены в таблице 6.

Таблица 6 – Лабораторные занятия и их трудоемкость

№ п/п	Наименование лабораторных работ	Трудоемкость, (час)	Из них практической подготовки, (час)	№ раздела дисциплины
	Методы выявления рисков	2	1	2
	Методы оценки рисков	2	1	2
	Принятие управленческих решений с помощью дерева решений	2	1	3
	Оценка чувствительности инвестиционного проекта	2	1	3
Всего		8		

4.5. Курсовое проектирование/ выполнение курсовой работы

Учебным планом не предусмотрено

4.6. Самостоятельная работа обучающихся

Виды самостоятельной работы и ее трудоемкость приведены в таблице 7.

Таблица 7 – Виды самостоятельной работы и ее трудоемкость

Вид самостоятельной работы	Всего, час	Семестр 8, час
1	2	3
Изучение теоретического материала дисциплины (ТО)	23	23
Курсовое проектирование (КП, КР)		
Расчетно-графические задания (РГЗ)		
Выполнение реферата (Р)		
Подготовка к текущему контролю успеваемости (ТКУ)	20	20
Домашнее задание (ДЗ)		
Контрольные работы заочников (КРЗ)	20	20
Подготовка к промежуточной аттестации (ПА)	20	20
Всего:	83	83

5. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся указаны в п.п. 8-10.

6. Перечень основной и дополнительной литературы

6.1. Основная литература

Перечень основной литературы приведен в таблице 7.

Таблица 7 – Перечень основной литературы

Шифр	Библиографическая ссылка / URL адрес	Количество экземпляров в библиотеке (кроме электронных экземпляров)
005 К 82	Кричевский, М.Л. Методы исследований в менеджменте. - М.: Кнорус, 2016. -296 с	17
978-5-9776-0487-1	Ряховская, А. Н. Риск-менеджмент — основа устойчивости бизнеса : учеб. пособие /А. Н. Ряховская, О. Г. Крюкова, М. О. Кузнецова; под ред. О. Г. Крюковой. — Москва : Магистр: ИНФРА-М, 2019. — 256с. - ISBN 978-5-16-106807-6. - Текст : электронный. - URL: https://new.znaniyum.com/catalog/product/1019768	
978-5-16-106807-6	Ряховская, А. Н. Риск-менеджмент — основа устойчивости бизнеса : учеб. пособие /А. Н.	

	Ряховская, О. Г. Крюкова, М. О. Кузнецова; под ред. О. Г. Крюковой. — Москва : Магистр: ИНФРА-М, 2019. — 256с. - ISBN 978-5-16-106807-6. - Текст : электронный. - URL: https://new.znanium.com/catalog/product/1019768	
978-5-288-05936-0	Окулов, В. Л. Риск-менеджмент : основы теории и практика применения : учебное пособие / В. Л. Окулов. - СПб : Изд-во С.-Петерб. ун-та, 2019. - 280 с. - ISBN 978-5-288-05936-0. - Текст : электронный. - URL: https://new.znanium.com/catalog/product/1080924	
978-5-9765-3240-3	Слепухина, Ю. Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках: Учебное пособие / Слепухина Ю.Э., - 2-е изд., стер. - Москва :Флинта, 2017. - 215 с.: ISBN 978-5-9765-3240-3. - Текст : электронный. - URL: https://new.znanium.com/catalog/product/959340	

6.2. Дополнительная литература

Перечень дополнительной литературы приведен в таблице 8.

Таблица 8 – Перечень дополнительной литературы

Шифр	Библиографическая ссылка/ URL адрес	Количество экземпляров в библиотеке (кроме электронных экземпляров)
978-5-238-01506-4	Риск-менеджмент инвестиционного проекта: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под ред. М.В. Грачевой, А.Б. Секерина. — М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. - 544 с. - ISBN 978-5-238-01506-4. - Текст : электронный. - URL: https://new.znanium.com/catalog/product/1028577	
978-5-16-104677-7	Домащенко, Д. В. Современные подходы к корпоративному риск-менеджменту: методы и инструменты / Домащенко Д.В., Финогенова Ю.Ю. - Москва :Магистр, НИЦ ИНФРА-М, 2019. - 304 с.: . - ISBN 978-5-16-104677-7. - Текст : электронный. - URL: https://new.znanium.com/catalog/product/1006768	
978-5-9776-0355-3	Банковский менеджмент: Учебник / Русанов Ю.Ю., Бадалов Л.А., Маганов В.В.; Под ред. Русанова Ю.Ю. - М.:Магистр, НИЦ ИНФРА-М, 2019. - 480 с. - ISBN . - Текст : электронный. - URL:	

	https://new.znaniy.com/catalog/product/1009782	
978-5-288-05651-2	Кудрявцев, А. А. Введение в количественный риск-менеджмент: Учебник / Кудрявцев А.А., Радионов А.В. - СПб:СПбГУ, 2016. - 192 с.: ISBN 978-5-288-05651-2. - Текст : электронный. - URL: https://new.znaniy.com/catalog/product/941170	
978-5-16-014777-2	Серебрякова, Т. Ю. Риски организации: их учет, анализ и контроль : монография / Т.Ю. Серебрякова, О.Г. Гордеева. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 233 с. — (Научная мысль). — DOI 10.12737/monography_5c9c6a63e58680.57259733. - ISBN 978-5-16-107282-0. - Текст : электронный. - URL: https://new.znaniy.com/catalog/product/1079420	

7. Перечень электронных образовательных ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

Перечень электронных образовательных ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины приведен в таблице 9.

Таблица 9 – Перечень электронных образовательных ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

URL адрес	Наименование
http://www.ecsocman.edu.ru	Федеральный образовательный портал «Экономика, социология, менеджмент»
http://www.gks.ru/	Федеральная служба государственной статистики
http://www.e-xecutive.ru/	Интернет сообщество профессиональных менеджеров

8. Перечень информационных технологий

8.1. Перечень программного обеспечения, используемого при осуществлении образовательного процесса по дисциплине.

Перечень используемого программного обеспечения представлен в таблице 10.

Таблица 10– Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование
	Не предусмотрено

8.2. Перечень информационно-справочных систем, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

Перечень используемых информационно-справочных систем представлен в таблице 11.

Таблица 11– Перечень информационно-справочных систем

№ п/п	Наименование
-------	--------------

	Не предусмотрено
--	------------------

9. Материально-техническая база

Состав материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине, представлен в таблице 12.

Таблица 12 – Состав материально-технической базы

Таблица 12 – Состав материально-технической базы

№ п/п	Наименование составной части материально-технической базы	Номер аудитории (при необходимости)
1	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа – укомплектована специализированной (учебной) мебелью, набором демонстрационного оборудования и учебно-наглядными пособиями, обеспечивающими тематические иллюстрации, соответствующие рабочим учебным программам дисциплин (модулей).	
2	Аудитория (лаборатория) для проведения лабораторных работ – Аудитория укомплектована специализированной мебелью, техническими средствами обучения, оснащена необходимым лабораторным оборудованием.	
4	Помещение для самостоятельной работы – укомплектовано специализированной (учебной) мебелью, оснащено компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечено доступом в электронную информационно-образовательную среду организации	
5	Учебная аудитория для текущего контроля и промежуточной аттестации - укомплектована специализированной (учебной) мебелью, техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации.	

10. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации

10.1 Состав оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине приведен в таблице 13.

Таблица 13 – Состав оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Вид промежуточной аттестации	Перечень оценочных средств
Дифференцированный зачёт	Список вопросов; Задачи. Тесты

10.1. Перечень компетенций, относящихся к дисциплине, и этапы их формирования в процессе освоения образовательной программы приведены в таблице 14.

Таблица 14 – Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Номер семестра	Этапы формирования компетенций по дисциплинам/практикам в процессе освоения ОП
ОК-3 «способность использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности»	
1	Экономика. Микроэкономика
2	Экономика. Макроэкономика
3	Институциональная экономика
3	Мировая экономика и международные экономические отношения
3	Экономика организации
4	Институциональная экономика
4	Мировая экономика и международные экономические отношения
5	Маркетинг
7	Оценка инвестиций
8	Риск-менеджмент
ОК-6 «способность к самоорганизации и самообразованию»	
1	Безопасность жизнедеятельности
1	Иностранный язык
1	Информатика
1	История
1	История управленческой мысли
1	Математика. Математический анализ
1	Физическая культура
1	Экономика. Микроэкономика
2	Иностранный язык
2	Информатика
2	Математика. Аналитическая геометрия и линейная алгебра
2	Математика. Математический анализ
2	Правоведение
2	Прикладная физическая культура (элективный модуль)
2	Учебная практика по получению первичных профессиональных умений и навыков
2	Философия
2	Экономика. Макроэкономика
3	Иностранный язык
3	Институциональная экономика
3	Математика. Теория вероятностей и математическая статистика
3	Мировая экономика и международные экономические отношения
3	Основы менеджмента
3	Прикладная физическая культура (элективный модуль)
3	Социология и политология

3	Статистика
3	Экономика организации
4	Деловая этика
4	Иностранный язык
4	Институциональная экономика
4	Мировая экономика и международные экономические отношения
4	Организация связей с общественностью
4	Основы менеджмента
4	Прикладная физическая культура (элективный модуль)
4	Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности
4	Психология и педагогика
4	Социально-экономическая статистика
4	Теория организации
4	Финансовый учет
5	Деловой иностранный язык
5	Деловые коммуникации
5	Иностранный язык (второй)
5	Информационные системы в менеджменте
5	Маркетинг
5	Методы принятия управленческих решений
5	Моделирование бизнес-процессов
5	Организационное поведение
5	Прикладная физическая культура (элективный модуль)
5	Финансовые рынки и институты
5	Финансовый анализ
6	Деловой иностранный язык
6	Иностранный язык (второй)
6	Информационные технологии
6	Исследование систем управления
6	Основы информационной безопасности
6	Прикладная физическая культура (элективный модуль)
6	Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности
6	Управление человеческими ресурсами
6	Управленческий учет
6	Финансовые рынки и институты
6	Финансовый менеджмент
7	Бизнес-планирование
7	Государственное и муниципальное управление
7	Оценка инвестиций

7	Стратегический менеджмент
7	Управление изменениями
7	Управление качеством
7	Управление операциями
7	Управление проектами
7	Управление развитием персонала
7	Финансовый менеджмент
8	Антикризисное управление
8	Деловое администрирование
8	Конфликтология
8	Корпоративная социальная ответственность
8	Производственная преддипломная практика
8	Риск-менеджмент
8	Стратегический менеджмент
8	Управление вознаграждением персонала
8	Управление изменениями
8	Управленческое консультирование
ПК-11 «владение навыками анализа информации о функционировании системы внутреннего документооборота организации, ведения баз данных по различным показателям и формирования информационного обеспечения участников организационных проектов»	
5	Информационные системы в менеджменте
5	Моделирование бизнес-процессов
6	Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности
7	Бизнес-планирование
8	Деловое администрирование
8	Риск-менеджмент
ПК-15 «умение проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании»	
5	Финансовые рынки и институты
5	Финансовый анализ
6	Финансовые рынки и институты
6	Финансовый менеджмент
7	Оценка инвестиций
7	Финансовый менеджмент
8	Производственная преддипломная практика
8	Риск-менеджмент
ПК-16 «владение навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов»	
5	Финансовые рынки и институты
6	Производственная практика по получению

	профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности
6	Финансовые рынки и институты
6	Финансовый менеджмент
7	Финансовый менеджмент
8	Риск-менеджмент

10.2. В качестве критериев оценки уровня сформированности (освоения) у обучающихся компетенций применяется шкала модульно–рейтинговой системы университета. В таблице 15 представлена 100–балльная и 4–балльная шкалы для оценки сформированности компетенций.

Таблица 15 –Критерии оценки уровня сформированности компетенций

Оценка компетенции		Характеристика сформированных компетенций
100-балльная шкала	4-балльная шкала	
$85 \leq K \leq 100$	«отлично» «зачтено»	- обучающийся глубоко и всесторонне усвоил программный материал; - уверенно, логично, последовательно и грамотно его излагает; - опираясь на знания основной и дополнительной литературы, тесно привязывает усвоенные научные положения с практической деятельностью направления; - умело обосновывает и аргументирует выдвигаемые им идеи; - делает выводы и обобщения; - свободно владеет системой специализированных понятий.
$70 \leq K \leq 84$	«хорошо» «зачтено»	- обучающийся твердо усвоил программный материал, грамотно и по существу излагает его, опираясь на знания основной литературы; - не допускает существенных неточностей; - увязывает усвоенные знания с практической деятельностью направления; - аргументирует научные положения; - делает выводы и обобщения; - владеет системой специализированных понятий.
$55 \leq K \leq 69$	«удовлетворительно» «зачтено»	- обучающийся усвоил только основной программный материал, по существу излагает его, опираясь на знания только основной литературы; - допускает несущественные ошибки и неточности; - испытывает затруднения в практическом применении знаний направления; - слабо аргументирует научные положения; - затрудняется в формулировании выводов и обобщений; - частично владеет системой специализированных понятий.
$K \leq 54$	«неудовлетворительно» «не зачтено»	- обучающийся не усвоил значительной части программного материала; - допускает существенные ошибки и неточности при рассмотрении проблем в конкретном направлении; - испытывает трудности в практическом применении знаний; - не может аргументировать научные положения; - не формулирует выводов и обобщений.

10.3. Типовые контрольные задания или иные материалы:

1. Вопросы (задачи) для экзамена (таблица 16)

Таблица 16 – Вопросы (задачи) для экзамена

№ п/п	Перечень вопросов (задач) для экзамена
	1. История становления и развития дисциплины «Риск – менеджмент». 2. Определение риска и неопределенности. 3. Объективная и субъективная категории риска. 4. Актуальные проблемы риск-менеджмента. 5. Управление риском в организациях. Общая схема процесса управления. 6. Общая характеристика методов воздействия на риск. 7. Управление риском в организациях. Структура управления риском. 8. Классификация рисков. 9. Методы выявления рисков. Стандартный опросный лист. Структурные диаграммы. 10. Методы выявления рисков. SWOT-анализ, метод формулирования гипотез. 11. Методы выявления рисков. «галстук -бабочка» 12. Методы выявления рисков. Дерево проблем. 13. Методы выявления рисков. Карты потоков. Анализ финансовой и управленческой отчетности. 14. Методы выявления рисков. Анализ финансовой и управленческой отчетности. 15. Методы выявления рисков. Прямая инспекция. Консультации с экспертами. 16. Способы оценки степени риска. 17. Оценка вероятности неблагоприятных событий. Деревья событий. Метод индексов опасности. 18. Оценка вероятности неблагоприятных событий. Метод индексов опасности. 19. Оценка вероятности неблагоприятных событий. Метод «события – последствия» 20. Оценка вероятности неблагоприятных событий. Деревья отказов. 21. Математические методы оценки рисков. Древо вероятностей. 22. Математические методы оценки рисков. Древо решений. 23. Статические методы оценки рисков. 24. Организация риск – менеджмента. 25. Стандарты риск-менеджмента.

2. Вопросы (задачи) для зачета / дифференцированного зачета (таблица 17)

Таблица 17 – Вопросы (задачи) для зачета / дифф. зачета

№ п/п	Перечень вопросов (задач) для зачета / дифференцированного зачета
	Учебным планом не предусмотрено

3. Темы и задание для выполнения курсовой работы / выполнения курсового проекта (таблица 18)

Таблица 18 – Примерный перечень тем для выполнения курсовой работы / выполнения курсового проекта

№ п/п	Примерный перечень тем для выполнения курсовой работы / выполнения курсового проекта
	Учебным планом не предусмотрено

4. Вопросы для проведения промежуточной аттестации при тестировании (таблица 19)

Таблица 19 – Примерный перечень вопросов для тестов

№ п/п	Примерный перечень вопросов для тестов
1	Управление риском – это: 1. Отказ от рискованного проекта 2. Комплекс мер, направленных на снижение вероятности реализации риска 3. Комплекс мер, направленных на компенсацию, снижение, перенесение, принятие риска или уход от него 4. Комплекс мероприятий, направленных на подготовку к реализации риска
2	Что из перечисленного не является функциями субъекта управления в риск-менеджменте? 1. Прогнозирование 2. Нормирование 3. Организация 4. Регулирование
3	Какие риски могут принести дополнительную прибыль фирме? 1. Спекулятивные 2. Чистые 3. Ретроспективные 4. Любые
4	Коммерческий риск – это риск, возникающий: 1. На коммерческих предприятиях 2. При заключении коммерческих сделок 3. В процессе реализации товаров или услуг 4. В процессе производства товаров или услуг
5	Инновационный риск - это: 1. Риск срыва сроков сдачи результатов научно-технических исследований 2. Риск того, что новый товар не будет принят рынком 3. Риск того, что инновационный проект не будет реализован или окуплен 4. Риск, связанный с утечкой информации об используемых фирмой инновациях
6	При наличии неопределенностей процесс выбора оптимальных решений: 1. Усложняется 2. Упрощается 3. Остается неизменным 4. Нет зависимости
7	Какой прогнозируемостью характеризуется наступления события (Pt) при полной определенности? 1. 0,3 2. 0,7 3. близкой к единице 4. близкой к нулю

8	Чем рискованнее проект, тем норма его доходности должна быть: 1. Ниже 2. Выше 3. Норма доходности не зависит от риска 4. Нет правильного ответа
9	Какой метод оценки вероятностей используется в большинстве случаев ? 1. Система неопределенностей 2. Нормальное распределение 3. Пороговые значения риска 4. Все перечисленные метод
10	В процессе принятия управленческих решений предпринимателю целесообразно различать и выделять определенные области (зоны риска) в зависимости от уровня возможных (ожидаемых) потерь. Для этого разработаны и используются: 1. Изометрические шкалы 2. Шкалы воздействия 3. Шкалы риска 4. Все ответы верны
11	Разновидностью экспертного метода является: 1. Метод Дельфи 2. Метод Гаусса 3. Метод Иванова 4. Все ответы верны
12	Методы управления рисками, предполагающие исключение рисков ситуации из бизнеса, носят название: 1. Методы диссипации риска 2. Методы компенсации риска 3. Методы уклонения от риска 4. Методы локализации риска
13	Методы управления рисками, относящиеся к упреждающим методам управления, носят название: 1. Методы диссипации риска 2. Методы компенсации риска 3. Методы уклонения от риска 4. Методы локализации риска
14	Процесс снижения риска за счет увеличения разнообразия видов деятельности, рынков сбыта или каналов поставок носит название: 1. Конвергенция 2. Фокусирование 3. Диверсификация 4. Дифференцирование
15	При использовании метода «Передача риска» покрытие убытка происходит за счет: 1. Самострахования 2. Займа 3. Резервов 4. Страхования

5. Контрольные и практические задачи / задания по дисциплине (таблица 20)

Таблица 20 – Примерный перечень контрольных и практических задач / заданий

№ п/п	Примерный перечень контрольных и практических задач / заданий
	1. Методы выявления рисков. Анализ финансовой и управленческой отчетности. 2. Методы выявления рисков. Карты потоков

	3. Способы оценки степени риска. 4. Количественные методы оценки рисков. Дерево вероятностей. Дерево решений. 5. Статистические методы оценки. 6. Волатильность рынка, VaR 7. Оценка вероятности неблагоприятных событий. Деревья событий. 8. Оценка вероятности неблагоприятных событий. «галстук – бабочка». 9. Оценка вероятности неблагоприятных событий. Метод «события – последствия» 10. Оценка вероятности неблагоприятных событий. Деревья отказов. 11. Построение полей риска
--	---

10.4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и / или опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, содержатся в Положениях «О текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов ГУАП, обучающихся по программам высшего образования» и «О модульно-рейтинговой системе оценки качества учебной работы студентов в ГУАП».

11. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

11.1. Методические указания для обучающихся по освоению лекционного материала

Основное назначение лекционного материала – логически стройное, системное, глубокое и ясное изложение учебного материала. Назначение современной лекции в рамках дисциплины не в том, чтобы получить всю информацию по теме, а в освоении фундаментальных проблем дисциплины, методов научного познания, новейших достижений научной мысли. В учебном процессе лекция выполняет методологическую, организационную и информационную функции. Лекция раскрывает понятийный аппарат конкретной области знания, её проблемы, дает цельное представление о дисциплине, показывает взаимосвязь с другими дисциплинами.

Планируемые результаты при освоении обучающимися лекционного материала:

- получение современных, целостных, взаимосвязанных знаний, уровень которых определяется целевой установкой к каждой конкретной теме;
- получение опыта творческой работы совместно с преподавателем;
- развитие профессионально-деловых качеств, любви к предмету и самостоятельного творческого мышления.
- появление необходимого интереса, необходимого для самостоятельной работы;
- получение знаний о современном уровне развития науки и техники и о прогнозе их развития на ближайшие годы;
- научиться методически обрабатывать материал (выделять главные мысли и положения, приходить к конкретным выводам, повторять их в различных формулировках);
- получение точного понимания всех необходимых терминов и понятий.

Лекционный материал может сопровождаться демонстрацией слайдов и использованием раздаточного материала при проведении коротких дискуссий об особенностях применения отдельных тематик по дисциплине.

Структура предоставления лекционного материала:

1. Формулировка темы лекции с указанием основных рассматриваемых вопросов.
2. Изложение вводной части.
3. Изложение основной части.
4. Примеры решения задач по теме лекции.
5. Обсуждение полученных результатов.
6. Краткие выводы по рассмотренным вопросам.
7. Ответы на вопросы студентов.

Методические указания по освоению лекционного материала виде текстовых файлов и презентаций на обозначенные лекционные темы представлены в системе LMS

<https://lms.guap.ru/new/course/view.php?id=5733>

11.2 Методические указания для обучающихся по участию в семинарах *(не предусмотрено)*

11.2. Методические указания для обучающихся по прохождению практических занятий *(не предусмотрено)*

11.3. Методические указания для обучающихся по выполнению лабораторных работ *(не предусмотрено)*

В ходе выполнения лабораторных работ обучающийся должен углубить и закрепить знания, практические навыки, овладеть современной методикой и техникой эксперимента в соответствии с квалификационной характеристикой обучающегося. Выполнение лабораторных работ состоит из экспериментально-практической, расчетно-аналитической частей и контрольных мероприятий.

Выполнение лабораторных работ обучающимся является неотъемлемой частью изучения дисциплины, определяемой учебным планом и относится к средствам, обеспечивающим решение следующих основных задач у обучающегося:

- приобретение навыков исследования процессов, явлений и объектов, изучаемых в рамках данной дисциплины;
- закрепление, развитие и детализация теоретических знаний, полученных на лекциях;
- получение новой информации по изучаемой дисциплине;
- приобретение навыков самостоятельной работы с лабораторным оборудованием и приборами.

Задание к проведению лабораторных работ:

Вариант задания к каждой лабораторной работе обучающийся получает в соответствии с номером в списке группы.

Требования к проведению лабораторных работ:

1. Обучающийся должен обладать знаниями по теме лабораторной работы.
2. Обучающийся должен выполнить работу в соответствии с требованиями, изложенными в методических указаниях к ее проведению.

3. Обучающийся по результатам работы должен подготовить отчет и защитить его.

Структура и форма отчета о лабораторной работе:

Отчет о лабораторной работе должен включать в себя: титульный лист, цель работы, формулировку задания, теоретические положения, используемые при выполнении лабораторной работы, описание процесса выполнения лабораторной работы, полученные результаты и выводы.

Требования к оформлению отчета о лабораторной работе

По каждой лабораторной работе выполняется отдельный отчет. Титульный лист оформляется в соответствии с шаблоном (образцом) приведенным на сайте ГУАП (www.guap.ru) в разделе «Сектор нормативной документации». Текстовые и графические материалы оформляются в соответствии с действующими ГОСТами и требованиями, приведенными на сайте ГУАП (www.guap.ru) в разделе «Сектор нормативной документации».

Методические указания к практическим занятиям находятся в виде электронного ресурса в сети лабораторий Центра информационных технологий ГУАП:

11.4. Методические указания для обучающихся по прохождению курсового проектирования/выполнения курсовой работы (*не предусмотрено*)

11.5. Методические указания для обучающихся по прохождению самостоятельной работы

В ходе выполнения самостоятельной работы, обучающийся выполняет работу по заданию и при методическом руководстве преподавателя, но без его непосредственного участия.

Для обучающихся по заочной форме обучения, самостоятельная работа может включать в себя контрольную работу.

В процессе выполнения самостоятельной работы, у обучающегося формируется целесообразное планирование рабочего времени, которое позволяет им развивать умения и навыки в усвоении и систематизации приобретаемых знаний, обеспечивает высокий уровень успеваемости в период обучения, помогает получить навыки повышения профессионального уровня.

Методическими материалами, направляющими самостоятельную работу обучающихся являются:

- учебно-методический материал по дисциплине;
- методические указания по выполнению контрольных работ (для обучающихся по заочной форме обучения).

11.6. Методические указания для обучающихся по прохождению текущего контроля успеваемости.

Текущий контроль успеваемости предусматривает контроль качества знаний обучающихся, осуществляемого в течение семестра с целью оценивания хода освоения дисциплины.

Текущий контроль и промежуточная аттестация производится с использованием модульно - рейтинговой 100- балльной системы в которой 60 баллов относятся к текущему контролю успеваемости; 40 баллов – к промежуточной аттестации.

Преимуществом использования модульно – рейтинговой системы является ее гибкость, более точная оценка выполненных обучающимся работ в течение семестра и

необходимость выполнения всех, указанных в данной РПД, работ в течение семестра для положительного итога промежуточной аттестации по дисциплине.

Текущий контроль успеваемости по дисциплине «Оценка финансовых рисков в области управления человеческими ресурсами» осуществляется в следующих формах:

1. Выполнение контрольных работ.

Контрольные работы проводятся как контроль компетенций студентов после изучения соответствующей темы на занятиях. Контрольные работы предусмотрены по следующим темам:

1. Количественные методы оценки риска. Статистический метод оценки рисков;
2. Принятие управленческого решения на основе дерева решений;
3. Разработка творческих альтернатив на основе метода фокальных объектов.

Контрольные работы имеют несколько вариантов. Максимальная сумма баллов за контрольную работу-5 баллов.

2. Выполнение аудиторных и внеаудиторных заданий.

Практические задания относятся к оценке практических навыков и опыта обучающихся в разработке управленческих решений: выявлению управленческой проблемы, анализу управленческой проблемы, разработке и обоснованию управленческого решения.

Аудиторные практические задания предусмотрены на следующие темы:

5. Выявление рисков с помощью метода «галстук- бабочка».
6. Оценка рисков с помощью метода «дерево отказов».

Аудиторные практические задания носят ситуационный творческий характер. Максимальная сумма баллов за задание 15 баллов.

Внеаудиторное практическое задание относится к самостоятельной работе студента. выполняется по теме «Оценка эффективности и рисков при принятии решений в области найма (адаптации, развития персонала)

Принятие управленческого решения с использованием метода парных сравнений». Выполняется индивидуально по выбранному варианту (15 баллов)

Результаты текущей аттестации учитываются при проведении промежуточной аттестации следующим образом:

1. Для допуска к промежуточной аттестации студент должен выполнить большинство текущих задания семестра.
2. Для допуска к промежуточной аттестации студент должен набрать не менее 30 баллов.
3. Баллы, полученные при текущей аттестации, учитываются в экзаменационной оценке.

11.7. Методические указания для обучающихся по прохождению промежуточной аттестации.

Промежуточная аттестация обучающихся предусматривает оценивание промежуточных и окончательных результатов обучения по дисциплине. Она включает в себя:

– дифференцированный зачет – это форма оценки знаний, полученных обучающимся при изучении дисциплины, при выполнении курсовых проектов, курсовых работ, научно-исследовательских работ и прохождении практик с аттестационной оценкой «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

Промежуточная аттестация осуществляется по билетам, которые включают в себя теоретические вопросы или тестовые задания, позволяющие оценить полученные обучающимися знания, и решение задач, что позволяет оценить приобретённые обучающимися умения и навыки.

Зачет оценивается по 40 - балльной системе. Далее полученные баллы суммируются с баллами семестра. Итог переводится в 5- балльную оценочную систему по следующей шкале:

- ниже 55 баллов- «неудовлетворительно»;
- 55-69 баллов – «удовлетворительно»;
- 70-84 балла –«хорошо»;
- 85-100 баллов- «отлично».

Лист внесения изменений в рабочую программу дисциплины

Дата внесения изменений и дополнений. Подпись внесшего изменения	Содержание изменений и дополнений	Дата и № протокола заседания кафедры	Подпись зав. кафедрой