


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

Кафедра №85

«УТВЕРЖДАЮ»
Руководитель направления

д.э.н., проф.
(должность, уч. степень, звание)


В.Б. Сироткин
(подпись)

«24» июня 2021г

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Риск-менеджмент»
(Наименование дисциплины)

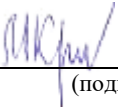
| | |
|---|------------------------------------|
| Код направления подготовки/ специальности | 38.03.02 |
| Наименование направления подготовки/ специальности | Менеджмент |
| Наименование направленности | Управление человеческими ресурсами |
| Форма обучения | очно-заочная |

Санкт-Петербург– 2021

Лист согласования рабочей программы дисциплины

Программу составил (а)

проф. д.т.н. проф.
(должность, уч. степень, звание)

 05.05.2021
(подпись, дата)

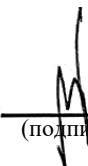
М.Л.Кричевский
(инициалы, фамилия)

Программа одобрена на заседании кафедры № 85

«11» мая 2021 г, протокол № 10

Заведующий кафедрой № 85

д.э.н., проф.
(уч. степень, звание)

 11.05.21
(подпись, дата)

В.Б. Сироткин
(инициалы, фамилия)

Ответственный за ОП ВО 38.03.02(03)

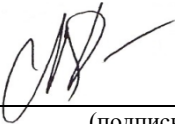
доц., к.э.н.
(должность, уч. степень, звание)

 11.05.2021
(подпись, дата)

С.В. Дмитриева
(инициалы, фамилия)

Заместитель директора института №8 по методической работе

доц., к.э.н., доц.
(должность, уч. степень, звание)

 17.05.2021
(подпись, дата)

Л.Г. Фетисова
(инициалы, фамилия)

Аннотация

Дисциплина «Риск-менеджмент» входит в образовательную программу высшего образования – программу бакалавриата по направлению подготовки/ специальности 38.03.02 «Менеджмент» направленности «Управление человеческими ресурсами». Дисциплина реализуется кафедрой «№85».

Дисциплина нацелена на формирование у выпускника следующих компетенций:

ПК-5 «Способен проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений и разрабатывать экономически обоснованные мероприятия, направленные на минимизацию негативных последствий»

Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с изучением теоретических методов исследований оценивания риска и управления риском, которые возникают при решении различных задач менеджмента. Особое внимание уделено практическим задачам, в частности, количественным методам оценки риска. Для решения последних дисциплина включает нейронные сети, нечеткую логику, комбинацию указанных технологий и компьютерную практику освоения таких приемов.

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, практические занятия, самостоятельная работа обучающегося.

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

Получение студентами необходимых знаний, умений и 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. Дисциплина входит в состав части, формируемой участниками образовательных отношений, образовательной программы высшего образования (далее – ОП ВО).

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

В результате изучения дисциплины обучающийся должен обладать следующими компетенциями или их частями. Компетенции и индикаторы их достижения приведены в таблице 1.

Таблица 1 – Перечень компетенций и индикаторов их достижения

| Категория (группа) компетенции | Код и наименование компетенции | Код и наименование индикатора достижения компетенции |
|--------------------------------|--|---|
| Профессиональные компетенции | ПК-5 Способен проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений и разрабатывать экономически обоснованные мероприятия, направленные на минимизацию негативных последствий | ПК-5.3.2 знать виды рисков при реализации бизнес-плана, а также методы их предотвращения и снижения ПК-5.3.4 знать методы оценки экономического риска; инструменты формирования оценок риска; программное обеспечение для решения задач по оценке риска ПК-5.У.2 уметь оценивать воздействие рисков на разрабатываемые решения; предлагать мероприятия по минимизации их последствий ПК-5.У.4 уметь оценивать воздействие рисков на разрабатываемые решения; предлагать мероприятия по минимизации их последствий; рассчитывать количественные характеристики рисков ПК-5.В.2 владеть навыками диагностики, оценки и управления рисками при реализации инвестиционного проекта ПК-5.В.4 владеть навыками оценки риска в различных ситуациях; программными средствами расчета рисков; анализом полученных результатов и составлением отчета |

2. Место дисциплины в структуре ОП

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

- «финансовый менеджмент»,
- «информационная поддержка принятия решений»

Знания, полученные при изучении материала данной дисциплины, имеют как самостоятельное значение, так и могут использоваться 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 2 – Объем и трудоемкость дисциплины

| Вид учебной работы | Всего | Трудоемкость по семестрам |
|---|--------|---------------------------|
| | | №9 |
| 1 | 2 | 3 |
| Общая трудоемкость дисциплины, ЗЕ/ (час) | 3/ 108 | 3/ 108 |
| Из них часов практической подготовки | 17 | 17 |
| Аудиторные занятия, всего час. | 51 | 51 |
| в том числе: | | |
| лекции (Л), (час) | 34 | 34 |
| практические/семинарские занятия (ПЗ), (час) | 17 | 17 |
| лабораторные работы (ЛР), (час) | | |
| курсовой проект (работа) (КП, КР), (час) | | |
| экзамен, (час) | 36 | 36 |
| Самостоятельная работа, всего (час) | 21 | 21 |
| Вид промежуточной аттестации: зачет, дифф. зачет, экзамен (Зачет, Дифф. зач, Экз.**) | Экз. | Экз. |

Примечание: ** кандидатский экзамен

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 9 | | | | | |
| Раздел 1. Основные концепции риск-менеджмента | 10 | | | | |
| Тема 1.1. Цели и задачи риск-менеджмента. Тема 1.2. Классификация и виды рисков. | | | | | |
| Раздел 2. Риски в финансовой области | 12 | 5 | | | |
| Тема 2.1. Рыночный риск Тема 2.2. Кредитный риск | | | | | |
| Раздел 3. Внутренние рейтинговые системы | 12 | 12 | | | |
| Тема 3.1. Рейтинговая система на основе нечеткой логики Тема 3.2. Рейтинговая система на основе нейронных сетей | | | | | |
| Итого в семестре: | 34 | 17 | | | 21 |
| Итого | 34 | 17 | 0 | 0 | 21 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|

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 |
|---------------|---|
| 1 | <p>Раздел 1. Основные концепции риск-менеджмента</p> <p>Тема 1.1. Цели и задачи риск-менеджмента.</p> <p>Сущность риска. Цели и задачи риск-менеджмента. История становления и развития дисциплины. Субъективная и объективная категории риска. Возникновение риска в производственной и финансовой сферах.</p> <p>Тема 1.2. Классификация и виды рисков.</p> <p>Регуляторы рисков. Классификация и виды рисков. Финансовые риски. Стандарты в области риска. Методологии Базель-2 и Базель-3. Роль Центрального Банка в области регулирования риска.</p> |
| 2 | <p>Раздел 2. Риски в финансовой области</p> <p>Тема 2.1. Рыночный риск</p> <p>Разновидности рыночного риска. Основные модели расчета Value-at-Risk. Ковариационный метода расчета VaR. Метод исторических симуляций. Моделирование методом Монте-Карло. Метод обратных функций при моделировании. Сравнение методов оценки рыночного риска. Анализ сценариев.</p> <p>Тема 2.2. Кредитный риск</p> <p>Модели кредитного риска. Структурные модели дефолта. Модель Мертона. Оценивание в модели Мертона. KMV-модель. Модели, основанные на кредитной миграции. Пороговые модели. Индикаторы состояния и дефолта. Корреляция активов. Смешанные модели</p> |
| 3 | <p>Раздел 3. Внутренние рейтинговые системы</p> <p>Тема 3.1. Рейтинговая система на основе нечеткой логики</p> <p>Основные понятия нечеткой логики. Нечеткие множества. Функции принадлежности. Лингвистические переменные. Нечеткий логический вывод. Нечеткая база правил. Алгоритмы нечеткого вывода. Построение внутренней рейтинговой системы оценки риска на основе нечеткой логики.</p> <p>Тема 3.2. Рейтинговая система на основе нейронных сетей</p> <p>Основные сведения об искусственных нейронных сетях. Становление нейронной доктрины. Парадигмы обучения. Нейросетевые топологии. Алгоритмы обучения. Метод обратного распространения ошибки. Создание внутренней рейтинговой системы на основе нейронных сетей.</p> |

Примечание. Проведение лекционных занятий сопровождается демонстрацией слайдов по каждой теме дисциплины.

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 |
|-----------|---|----------------------------|---------------------|---------------------------------------|----------------------|
| Семестр 9 | | | | | |
| 1 | Формирование базы данных | Занятия по моделированию | 2 | | 2 |
| 2 | Метод главных компонентов | Занятия по моделированию | 3 | | 2 |
| 3 | Классификация с помощью нейронных сетей в пакете Statistica | Решение ситуационных задач | 3 | | 3 |
| 4 | Нейронная сеть в пакете Matlab | Решение ситуационных задач | 3 | | 3 |
| 5 | Кластерный анализ | Решение ситуационных задач | 3 | | 3 |
| 6 | Моделирование работы нечеткой системы | Решение ситуационных задач | 3 | | 3 |
| Всего | | | 17 | | |

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 |
|---------------------------------|---------------------------------|---------------------|---------------------------------------|----------------------|
| Учебным планом не предусмотрено | | | | |
| | | | | |
| Всего | | | | |

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 9, час |
|---|------------|----------------|
| 1 | 2 | 3 |
| Изучение теоретического материала дисциплины (ТО) | | 15 |
| Курсовое проектирование (КП, КР) | | |
| Расчетно-графические задания (РГЗ) | | |
| Выполнение реферата (Р) | | |
| Подготовка к текущему контролю успеваемости (ТКУ) | | 3 |
| Домашнее задание (ДЗ) | | |
| Контрольные работы заочников (КРЗ) | | |
| Подготовка к промежуточной аттестации (ПА) | | 3 |
| Всего: | 21 | 21 |

5. Перечень учебно-методического обеспечения

для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся указаны в п.п. 7-11.

6. Перечень печатных и электронных учебных изданий

Перечень печатных и электронных учебных изданий приведен в таблице 8.

Таблица 8– Перечень печатных и электронных учебных изданий

| Шифр/ URL адрес | Библиографическая ссылка | Количество экземпляров в библиотеке (кроме электронных экземпляров) |
|--------------------|--|--|
| 336 К 82 | Кричевский М.Л. Финансовые риски. Учебное пособие –М.: Кнорус, 2020. – 248 с. | 20 |
| 005 К 82 | Кричевский М.Л. Методы исследований в менеджменте. -М.: Кнорус, 2016. -296 с | 17 |
| | Кричевский М.Л. Прикладные задачи менеджмента. – М.: - Креативная экономика, 2018.- 210 с. | |
| | Кричевский М.Л., Мартынова. Ю.А., Дмитриева С.В. Методы машинного обучения в менеджменте. СПб.: ГУАП. 2019- 85с. | |
| | Вяткин, В.Н. Риск-менеджмент: учебник / В.Н. Вяткин, В.А. Гамза, Ф.В. Маевский. — Люберцы: Юрайт, 2016. — 353 с. | |
| | Балдин К. В., Голов Р. С., Передеряев И. И. | |

| | |
|--|--|
| Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: учебное пособие «Дашков и К ^о » 2017 г. 418 с. | |
|--|--|

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 |
|---|--|
| https://znanium.com/catalog/document?id=369991 | Хасянова С. Ю. Банковские риски: международные подходы к оценке и управлению М.: Инфра-М 2020 |
| http://znanium.com/bookread.php | Риск-менеджмент инвестиционного проекта [Электронный ресурс]: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина. - М.: ЮНИТИДАНА, 2012. |
| http://www.znanium.com/catalog.php | Базисная система риск-менеджмента организаций реального сектора экономики: Монография / Д.В. Соколов, А.В. Барчуков. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2013. |
| http://www.znanium.com/catalog.php | Механизм комплексной оценки и управления рисками предприятий промышленности: Монография / М.Р. Дзагоева, А.Р. Цховребов, Л.Э. Комаева. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. |

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

| № п/п | Наименование составной части материально-технической базы | Номер аудитории (при необходимости) |
|-------|---|-------------------------------------|
| 1 | Мультимедийная лекционная аудитория | 22-07 |
| 2 | Компьютерный класс | 14-06 (07,08,09) |

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 |
|------------------------------|---|
| Экзамен | Список вопросов к экзамену; Экзаменационные билеты; Задачи; Тесты. |

10.2. В качестве критериев оценки уровня сформированности (освоения) компетенций обучающимися применяется 5-балльная шкала оценки сформированности компетенций, которая приведена в таблице 14. В течение семестра может использоваться 100-балльная шкала модульно-рейтинговой системы Университета, правила использования которой, установлены соответствующим локальным нормативным актом ГУАП.

Таблица 14 – Критерии оценки уровня сформированности компетенций

| Оценка компетенции 5-балльная шкала | Характеристика сформированных компетенций |
|--|---|
| «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. |
| «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; |

| Оценка компетенции | Характеристика сформированных компетенций |
|---------------------------------------|---|
| 5-балльная шкала | |
| | <ul style="list-style-type: none"> – делает выводы и обобщения; – владеет системой специализированных понятий. |
| «удовлетворительно» «зачтено» | <ul style="list-style-type: none"> – 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. |
| «неудовлетворительно» «не зачтено» | <ul style="list-style-type: none"> – 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.

Вопросы (задачи) для экзамена представлены в таблице 15.

Таблица 15 – Вопросы (задачи) для экзамена

| № п/п | Перечень вопросов (задач) для экзамена | Код индикатора |
|-------|--|----------------|
| 1 | Сущность риска. | ПК-5.3.2 |
| 2 | Объективная и субъективная категории. | ПК-5.3.4 |
| 3 | ГОСТ Р 51897-2002 «Менеджмент риска. Термины и определения». | ПК-5.3.2 |
| 4 | Цели и задачи риск-менеджмента. | ПК-5.3.4 |
| 5 | Описание риска. Карта риска. | ПК-5.3.2 |
| 6 | Качественные и количественные оценки риска. | ПК-5.3.4 |
| 7 | Последствия и вероятности риска. | ПК-5.3.4 |
| 8 | Регуляторы риска. Базель-1. | ПК-5.3.2 |
| 9 | Базель-2. | ПК-5.3.2 |
| 10 | Введение Базель-3. | ПК-5.3.2 |
| 11 | Особенности внедрения Базель-3 в России. | ПК-5.3.4 |
| 12 | Классификация и виды рисков. | ПК-5.3.4 |
| 13 | Основные методы измерения риска в финансовой сфере. | ПК-5.3.4 |
| 14 | Разновидности рыночного риска. | ПК-5.3.2 |
| 15 | Ковариационный метод расчета <i>VaR</i> . | ПК-5.У.4 |
| 16 | Метод исторических симуляций. | ПК-5.У.2 |
| 17 | Моделирование случайных величин. | ПК-5.У.2 |
| 18 | Метод Монте-Карло при расчете <i>VaR</i> . | ПК-5.У.2 |
| 19 | Модели оценки финансовой несостоятельности предприятия. | ПК-5.У.4 |
| 20 | Модели Альтмана. | ПК-5.У.4 |
| 21 | Недостатки моделей Альтмана. | ПК-5.3.4 |
| 22 | Кредитные рейтинговые системы. | ПК-5.3.4 |
| 23 | "Тройка" ведущих рейтинговых агентств. | ПК-5.3.4 |
| 24 | Формирование рейтинговых агентств в России. | ПК-5.3.4 |
| 25 | Миграция рейтингов. | ПК-5.3.4 |

| | | |
|----|---|----------|
| 26 | Методология CreditMetrics. | ПК-5.3.4 |
| 27 | Структурные модели дефолта. | ПК-5.3.4 |
| 28 | Модель Мертона. | ПК-5.3.4 |
| 29 | KMV-модель. | ПК-5.3.4 |
| 30 | Пороговые модели. | ПК-5.3.4 |
| 31 | Международный стандарт ISO/IEC 31090-2009 «Риск-Мен» | ПК-5.3.4 |
| 32 | Количественные оценки риска по стандарту ISO/IEC 31090-2009 . | ПК-5.У.4 |
| 33 | Методология CreditRisk+. | ПК-5.У.4 |
| 34 | Классификация операционных рисков. | ПК-5.У.4 |
| 35 | Методы оценивания операционного риска. | ПК-5.У.4 |
| 36 | Страновой риск. | ПК-5.У.4 |
| 37 | Методы оценки страновых рейтингов. | ПК-5.У.4 |
| 38 | Управление кредитным риском. | ПК-5.У.4 |
| 39 | Управление операционным риском. | ПК-5.У.4 |
| 40 | Основы нечеткой логики. | ПК-5.В.2 |
| 41 | Понятие о нечетких множествах. | ПК-5.В.2 |
| 42 | Оценка риска посредством нечеткой логики. | ПК-5.В.2 |
| 43 | Программные продукты при использовании нечеткой логики. | ПК-5.В.2 |
| 44 | Преимущества и недостатки нечеткой логики при оценке риска. | ПК-5.В.4 |
| 45 | Основы искусственных нейронных сетей. | ПК-5.В.4 |
| 46 | Классификация нейронных сетей. | ПК-5.В.4 |
| 47 | Методы обучения нейронных сетей. | ПК-5.В.4 |
| 48 | Программные продукты при использовании нейронных сетей. | ПК-5.В.4 |
| 49 | Нейронные сети при оценке риска. | ПК-5.В.4 |
| 50 | Преимущества и недостатки нейронных сетей при оценке риска. | ПК-5.В.4 |

Вопросы (задачи) для зачета / дифф. зачета представлены в таблице 16.

Таблица 16 – Вопросы (задачи) для зачета / дифф. зачета

| № п/п | Перечень вопросов (задач) для зачета / дифф. зачета | Код индикатора |
|-------|---|----------------|
| | Учебным планом не предусмотрено | |

Перечень тем для курсового проектирования/выполнения курсовой работы представлены в таблице 17.

Таблица 17 – Перечень тем для курсового проектирования/выполнения курсовой работы

| № п/п | Примерный перечень тем для курсового проектирования/выполнения курсовой работы |
|-------|--|
| | Учебным планом не предусмотрено |

Вопросы для проведения промежуточной аттестации в виде тестирования представлены в таблице 18.

Таблица 18 – Примерный перечень вопросов для тестов

| № п/п | Примерный перечень вопросов для тестов | Код индикатора |
|-------|--|----------------|
| 1 | Сущность риска. | ПК-5.3.2 |
| 2 | Объективная и субъективная категории. | ПК-5.3.2 |
| 3 | Цели и задачи риск-менеджмента. | ПК-5.3.2 |
| 4 | Описание риска. Карта риска. | ПК-5.3.2 |

| | | |
|----|---|----------|
| 5 | Качественные и количественные оценки риска. | ПК-5.3.4 |
| 6 | Регуляторы риска. Базель-1. | ПК-5.3.4 |
| 7 | Базель-2. | ПК-5.3.4 |
| 8 | Введение Базель-3. | ПК-5.3.4 |
| 9 | Классификация и виды рисков. | ПК-5.3.4 |
| 10 | Основные методы измерения риска в финансовой сфере. | ПК-5.3.4 |
| 11 | Разновидности рыночного риска. | ПК-5.У.2 |
| 12 | Моделирование случайных величин. | ПК-5.У.2 |
| 13 | Модели Альтмана. | ПК-5.У.2 |
| 14 | Кредитные рейтинговые системы. | ПК-5.У.2 |
| 15 | "Тройка" ведущих рейтинговых агентств. | ПК-5.У.4 |
| 16 | Миграция рейтингов. | ПК-5.У.4 |
| 17 | Методология CreditMetrics. | ПК-5.3.4 |
| 18 | Модель Мертона. | ПК-5.3.4 |
| 19 | KMV-модель. | ПК-5.3.4 |
| 20 | Международный стандарт ISO/IEC 31090-2009 | ПК-5.3.4 |
| 21 | Классификация операционных рисков. | ПК-5.3.4 |
| 22 | Методы оценивания операционного риска. | ПК-5.3.4 |
| 23 | Методы оценки страновых рейтингов. | ПК-5.3.4 |
| 24 | Управление кредитным риском. | ПК-5.3.4 |
| 25 | Управление операционным риском. | ПК-5.3.4 |
| 26 | Основы нечеткой логики. | ПК-5.3.4 |
| 27 | Понятие о нечетких множествах. | ПК-5.В.2 |
| 28 | Оценка риска посредством нечеткой логики. | ПК-5.В.2 |
| 29 | Программные продукты при использовании нечеткой логики. | ПК-5.В.2 |
| 30 | Преимущества и недостатки нечеткой логики при оценке риска. | ПК-5.В.2 |
| 31 | Основы искусственных нейронных сетей. | ПК-5.В.4 |
| 32 | Классификация нейронных сетей. | ПК-5.В.4 |
| 33 | Методы обучения нейронных сетей. | ПК-5.В.4 |
| 34 | Программные продукты при использовании нейронных сетей. | ПК-5.В.4 |
| 35 | Нейронные сети при оценке риска. | ПК-5.В.4 |
| 36 | Преимущества и недостатки нейронных сетей при оценке риска. | ПК-5.В.4 |

Перечень тем контрольных работ по дисциплине обучающихся заочной формы обучения, представлены в таблице 19.

Таблица 19 – Перечень контрольных работ

| № п/п | Перечень контрольных работ |
|-------|----------------------------|
| | Не предусмотрено |

10.4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания индикаторов, характеризующих этапы формирования компетенций, содержатся в локальных нормативных актах ГУАП, регламентирующих порядок и процедуру проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся ГУАП.

11. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины
(Ниже приводятся рекомендации по составлению данного раздела)

11.1. Методические указания для обучающихся по освоению лекционного материала *(если предусмотрено учебным планом по данной дисциплине)*.

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: имеется учебное пособие

Кричевский М.Л. Финансовые риски. Учебное пособие, 3 изд. –М.: Кнорус, 2020.

Если методические указания по освоению лекционного материала имеются в изданном виде, в виде электронных ресурсов библиотеки ГУАП, системы LMS, кафедры и т.д., необходимо дать на них ссылку или привести URL адрес.

11.2. Методические указания для обучающихся по участию в семинарах *(если предусмотрено учебным планом по данной дисциплине)*

Основной целью для обучающегося является систематизация и обобщение знаний по изучаемой теме, разделу, формирование умения работать с дополнительными источниками информации, сопоставлять и сравнивать точки зрения, конспектировать прочитанное, высказывать свою точку зрения и т.п. В соответствии с ведущей дидактической целью содержанием семинарских занятий являются узловые, наиболее трудные для понимания и усвоения темы, разделы дисциплины. Спецификой данной формы занятий является совместная работа преподавателя и обучающегося над решением поставленной проблемы, а поиск верного ответа строится на основе чередования индивидуальной и коллективной деятельности.

При подготовке к семинарскому занятию по теме прослушанной лекции необходимо ознакомиться с планом его проведения, с литературой и научными публикациями по теме семинара.

Требования к проведению семинаров

Обязательно для заполнения преподавателем

Если методические указания по участию в семинарах имеются в изданном виде, в виде электронных ресурсов библиотеки ГУАП, системы LMS, кафедры и т.д., необходимо дать на них ссылку или привести URL адрес.

11.3. Методические указания для обучающихся по прохождению практических занятий *(если предусмотрено учебным планом по данной дисциплине)*

Практическое занятие является одной из основных форм организации учебного процесса, заключающаяся в выполнении обучающимися под руководством преподавателя комплекса учебных заданий с целью усвоения научно-теоретических основ учебной дисциплины, приобретения умений и навыков, опыта творческой деятельности.

Целью практического занятия для обучающегося является привитие обучающимся умений и навыков практической деятельности по изучаемой дисциплине.

Планируемые результаты при освоении обучающимся практических занятий:

- закрепление, углубление, расширение и детализация знаний при решении конкретных задач;
- развитие познавательных способностей, самостоятельности мышления, творческой активности;
- овладение новыми методами и методиками изучения конкретной учебной дисциплины;
- выработка способности логического осмысления полученных знаний для выполнения заданий;
- обеспечение рационального сочетания коллективной и индивидуальной форм обучения.

Требования к проведению практических занятий

На ПЗ проводятся занятия:

- по моделированию и формированию базы данных, с которой студент продолжает работать в последующих практических занятиях;
- по решению различных ситуационных задач, которые могут встречаться в практике менеджмента

Если методические указания по прохождению практических занятий имеются в изданном виде, в виде электронных ресурсов библиотеки ГУАП, системы LMS, кафедры и т.д., необходимо дать на них ссылку или привести URL адрес.

11.4. Методические указания для обучающихся по выполнению лабораторных работ *(если предусмотрено учебным планом по данной дисциплине)*

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 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 и требования к проведению лабораторных работ
Обязательно для заполнения преподавателем

Структура и форма отчета о лабораторной работе
Обязательно для заполнения преподавателем

Требования к оформлению отчета о лабораторной работе
Обязательно для заполнения преподавателем

Если методические указания по прохождению лабораторных работ имеются в изданном виде, в виде электронных ресурсов библиотеки ГУАП, системы LMS, кафедры и т.д., необходимо дать на них ссылку или привести URL адрес.

11.5. Методические указания для обучающихся по прохождению курсового проектирования/выполнения курсовой работы (*если предусмотрено учебным планом по данной дисциплине*)

Курсовой проект/ работа проводится с целью формирования у обучающихся опыта комплексного решения конкретных задач профессиональной деятельности.

Курсовой проект/ работа позволяет обучающемуся:

Структура пояснительной записки курсового проекта/ работы
Обязательно для заполнения преподавателем

Требования к оформлению пояснительной записки курсового проекта/ работы
Обязательно для заполнения преподавателем

Если методические указания по курсовому проектированию/ выполнению курсовой работы имеются в изданном виде, в виде электронных ресурсов библиотеки ГУАП, системы LMS, кафедры и т.д., необходимо дать на них ссылку или привести URL адрес.

11.6. 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).

Имеются учебные пособия автора курса:

- Кричевский М.Л. Финансовые риски. Учебное пособие –М.: Кнорус, 2020. – 248 с.

- Кричевский М.Л. Методы исследований в менеджменте. -М.: Кнорус, 2016. -296 с.

Если методические указания по прохождению самостоятельной работы имеются в изданном виде, в виде электронных ресурсов библиотеки ГУАП, системы LMS, кафедры и т.д., необходимо дать на них ссылку или привести URL адрес.

11.7. 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.

Обязательно для заполнения преподавателем: указываются требования и методы проведения текущего контроля успеваемости, а также как результаты текущего контроля успеваемости будут учитываться при проведении промежуточной аттестации.

11.8. Методические указания для обучающихся по прохождению промежуточной аттестации.

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

– экзамен – форма оценки знаний, полученных обучающимся в процессе изучения всей дисциплины или ее части, навыков самостоятельной работы, способности применять их для решения практических задач. Экзамен, как правило, проводится в период экзаменационной сессии и завершается аттестационной оценкой «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

– зачет – это форма оценки знаний, полученных обучающимся в ходе изучения учебной дисциплины в целом или промежуточная (по окончании семестра) оценка знаний обучающимся по отдельным разделам дисциплины с аттестационной оценкой «зачтено» или «не зачтено».

– 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».

Обязательно для заполнения преподавателем: указываются требования и методы проведения промежуточной аттестации.

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 |
|---|-----------------------------------|--------------------------------------|-----------------------|
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |
| | | | |