

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

Кафедра № 5

УТВЕРЖДАЮ

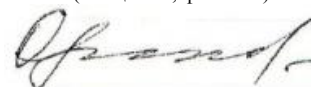
Руководитель направления

д.э.н., проф.

(должность, уч. степень, звание)

В.В. Окрепилов

(инициалы, фамилия)



(подпись)

23.06.2022 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Методы и средства оценки рисков»
(Наименование дисциплины)

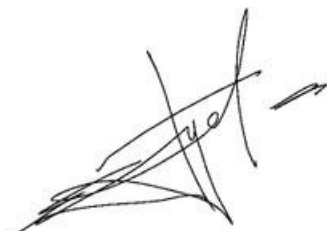
| | |
|---|---|
| Код направления подготовки/ специальности | 27.04.01 |
| Наименование направления подготовки/ специальности | Стандартизация и метрология |
| Наименование направленности | Метрологическое обеспечение интеллектуальных процессов и производств |
| Форма обучения | очная |

Лист согласования рабочей программы дисциплины

Программу составил (а)

Проф., д.т.н., доц

(должность, уч. степень, звание)



(подпись, дата)

23.06.2022

В.А. Тушавин

(инициалы, фамилия)

Программа одобрена на заседании кафедры № 5

23.06.2022 г, протокол № 01-06/2022

Заведующий кафедрой № 5

д.т.н., доц.

(уч. степень, звание)



(подпись, дата)

23.06.2022

Е.А. Фролова

(инициалы, фамилия)

Ответственный за ОП ВО 27.04.01(01)

доц., к.т.н.

(должность, уч. степень, звание)



(подпись, дата)

23.06.2022

А.С. Степашкина

(инициалы, фамилия)

Заместитель декана факультета №фпти по методической работе

доц., к.т.н.

(должность, уч. степень, звание)



(подпись, дата)

23.06.2022

Р.Н. Целмс

(инициалы, фамилия)

Аннотация

Дисциплина «Методы и средства оценки рисков» входит в образовательную программу высшего образования – программу магистратуры по направлению подготовки/специальности 27.04.01 «Стандартизация и метрология» направленности «Метрологическое обеспечение интеллектуальных процессов и производств». Дисциплина реализуется кафедрой «№5».

Дисциплина нацелена на формирование у выпускника следующих компетенций:

ПК-3 «Способен планировать деятельность метрологической службы организации»

ПК-4 «Способен обеспечивать функционирование системы менеджмента качества, управлять программами обеспечения надежности»

Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с организацией процессов управлением рисками операционной и проектной деятельности предприятия.

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

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

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 - овладение студентами теоретических и практических знаний в области организации процесса исследования и управления рисками инновационной деятельности. Формирование профессиональной подготовки в области разработки теоретических и математических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся к профессиональной деятельности, оценки и интерпретации полученных результатов, в том числе имеющими полидисциплинарный характер, предоставляющие возможности студентам развить и продемонстрировать навыки в области прогнозирования рисков и принятий решений в условиях неопределенности, связанных с инновационной деятельностью.

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-3 Способен планировать деятельность метрологической службы организации | ПК-3.3.1 знать области применения методов измерения, технологические возможности и области применения средств измерений, прогнозы измерительных потребностей экономики и общества |
| Профессиональные компетенции | ПК-4 Способен обеспечивать функционирование системы менеджмента качества, управлять программами обеспечения надежности | ПК-4.3.1 знать основные положения риск-менеджмента ПК-4.У.1 уметь оценивать и управлять рисками в системах обеспечения качества ПК-4.В.1 владеть навыками оценки и управления рисками в системах обеспечения качества |

2. Место дисциплины в структуре ОП

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

- «Технология и организация производства»,
- «Статистические методы в управлении сложными техническими системами».

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

- «Управление экологической безопасностью проектов».

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 |
|---|--------|---------------------------|
| | | №2 |
| 1 | 2 | 3 |
| Общая трудоемкость дисциплины, ЗЕ/ (час) | 3/ 108 | 3/ 108 |
| Из них часов практической подготовки | 17 | 17 |
| Аудиторные занятия, всего час. | 34 | 34 |
| в том числе: | | |
| лекции (Л), (час) | 17 | 17 |
| практические/семинарские занятия (ПЗ), (час) | 17 | 17 |
| лабораторные работы (ЛР), (час) | | |
| курсовой проект (работа) (КП, КР), (час) | | |
| экзамен, (час) | | |
| Самостоятельная работа, всего (час) | 74 | 74 |
| Вид промежуточной аттестации: зачет, дифф. зачет, экзамен (Зачет, Дифф. зач, Экз.**) | Зачет | Зачет |

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 2 | | | | | |
| Раздел 1. Общие принципы управления рисками | 2 | 0 | | | 10 |
| Раздел 2. Планирование управления рисками | 2 | 2 | | | 10 |
| Раздел 3. Идентификация рисков | 2 | 2 | | | 10 |
| Раздел 4. Качественный анализ рисков | 3 | 0 | | | 12 |
| Раздел 5. Количественный анализ рисков | 3 | 9 | | | 12 |
| Раздел 6. Планирование реагирования на риски | 2 | 0 | | | 10 |
| Раздел 7. Мониторинг и управление рисками | 3 | 4 | | | 10 |
| Итого в семестре: | 17 | 17 | | | 74 |
| Итого | 17 | 17 | 0 | 0 | 74 |

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 | Общие принципы управления рисками 1.1 Риск как предмет управления и исследования 1.2 Базовые концепции и определения 1.3 Управление рисками как группа процессов предприятия 1.4 Основные стандарты управления рисками в РФ |
| 2 | Планирование управления рисками 2.1 Входы процесса 2.2 Инструменты и методы 2.3 Выходы процесса |
| 3 | Идентификация рисков 3.1 Входы процесса идентификации рисков 3.2 Инструменты и методы процесса 3.3 Выходы процесса идентификации рисков |
| 4 | Качественный анализ рисков 4.1 Входы процесса качественного анализа рисков 4.2 Инструменты и методы 4.3 Выходы процесса качественного анализа рисков |
| 5 | Количественный анализ рисков 5.1 Входы процесса количественного анализа рисков 5.2 Инструменты и методы процесса 5.3 Выходы процесса количественного анализа рисков |
| 6 | Планирование реагирования на риски 6.1 Входы процесса 6.2 Инструменты и методы 6.3 Выходы процесса |
| 7 | Мониторинг и управление рисками 7.1 Входы процесса мониторинга и управления рисками 7.2 Инструменты и методы 7.3 Выходы процесса мониторинга и управления рисками |

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 2 | | | | | |
| 1 | Иерархическая схема рисков | Решение ситуационных задач | 2 | 2 | 2 |
| 2 | Анализ ограничений | Решение ситуационных задач | 2 | 2 | 3 |
| 3 | Анализ дерева решений | Решение ситуационных задач | 2 | 2 | 5 |
| 4 | Анализ чувствительности | Решение ситуационных задач | 3 | 3 | 5 |
| 5 | Имитационное моделирование | Решение ситуационных задач | 4 | 4 | 5 |

| | | | | | |
|-------|-------------------------|----------------------------|----|----|---|
| 6 | Технологии оценки риска | Решение ситуационных задач | 4 | 4 | 7 |
| Всего | | | 17 | 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 2, час |
|---|------------|----------------|
| 1 | 2 | 3 |
| Изучение теоретического материала дисциплины (ТО) | 44 | 44 |
| Курсовое проектирование (КП, КР) | | |
| Расчетно-графические задания (РГЗ) | | |
| Выполнение реферата (Р) | | |
| Подготовка к текущему контролю успеваемости (ТКУ) | 10 | 10 |
| Домашнее задание (ДЗ) | 10 | 10 |
| Контрольные работы заочников (КРЗ) | | |
| Подготовка к промежуточной аттестации (ПА) | 10 | 10 |
| Всего: | 74 | 74 |

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) |
|---|---|---|
| https://tushavin.ru/wp-content/uploads/2022/08/MISOR.pdf | Методы и средства оценки рисков: учебное пособие/В.А. Тушавин. СПб.: ГУАП, 2022 – 148 с. | |
| 005 В19 | Инновационный менеджмент : учебное пособие / И. В. Василевская. - 3-е изд. - М. : РИОР : ИНФРА-М, 2017. - 129 с. | 5 |
| 005 У 71 | Уродовских, В. Н. Управление рисками предприятия [Текст] : учебное пособие / В. Н. Уродовских. - М. : Вузовский учебник : ИНФРА-М, 2011. - 168 с. : рис., табл. - Библиогр.: с. 155 - 156. - ISBN 978-5-9558-0158-2 (Вузовский учебник). - ISBN 9785-16-004107-0 (ИНФРА-М) : 220.88 р. Имеет гриф Совета УМО по образованию в области менеджмента | 3 |

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://elibrary.ru/defaultx.asp | Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU |
| Science.quar.ru | Научно-инновационный портал ГУАП |

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 | Лекционная аудитория | |
| 2 | Мультимедийная лекционная аудитория | |

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 |
|------------------------------|---------------------------------------|
| Зачет | Список вопросов; Тесты; Задачи. |

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. |

| Оценка компетенции | Характеристика сформированных компетенций |
|---------------------------------------|---|
| 5-балльная шкала | |
| «хорошо» «зачтено» | <ul style="list-style-type: none"> – 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. |
| «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 |
|-------|--|----------------|
| | Учебным планом не предусмотрено | |

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 |
|-------|--|----------------|
| 1 | Сущность риска, основные элементы, причины возникновения. | ПК-3.3.1 |
| 2 | Объекты и субъекты риска | ПК-4.3.1 |
| 3 | Факторы риска | ПК-4.У.1 |
| 4 | Виды ущерба от риска | ПК-4.В.1 |
| 5 | Характеристика системы управления рисками. | ПК-3.3.1 |
| 6 | Суть, причины, процедуры и форма управления рисками | ПК-4.3.1 |
| 7 | Задачи, решаемые при управлении рисками, правила риск-менеджмента | ПК-4.У.1 |
| 8 | Основные принципы управления риском (избежание, снижение, принятие, отказ). | ПК-4.В.1 |
| 9 | Этапы процесса управления риском (выявление и оценка, сравнение методов воздействия на риск, выбор методов воздействия, на риск) | ПК-3.3.1 |
| 10 | Методы выявления риска. Опросные листы, карты | ПК-4.3.1 |

| | | |
|----|--|----------|
| | потоков, прямая инспекция, анализ финансовой и управленческой отчетности | |
| 11 | Суть и методы идентификации риска. Ценности подверженные рискам. Выявление факторов риска | ПК-4.У.1 |
| 12 | Статистические и вероятностные подходы к количественной оценке риска. | ПК-4.В.1 |
| 13 | Дисперсия и вариация как меры риска | ПК-3.3.1 |
| 14 | Специфические показатели, используемые для количественной оценки риска | ПК-4.3.1 |
| 15 | Построение профилей риска. Методы определения зон риска. Шкалы риска. Понятия и использование для оценки различных видов риска | ПК-4.У.1 |
| 16 | Точка безубыточности, операционный и финансовый рычаг в оценке производственных и коммерческих рисков | ПК-4.В.1 |
| 17 | Коэффициенты ликвидности как измерители риска ликвидности на промышленных компаниях и финансовых институтах. Методы определения и управления рисками ликвидности | ПК-3.3.1 |
| 18 | Оценка риска банкротства через показатели деятельности предприятия | ПК-4.3.1 |
| 19 | Моделирование портфельных рисков. Сущность и методы управления риском различными классами инвесторов | ПК-4.У.1 |
| 20 | Учет риска при принятии управленческих решений в условиях неопределенности | ПК-4.В.1 |
| 21 | Хеджирование рисков | ПК-3.3.1 |
| 22 | Источники финансирования риска. | ПК-4.3.1 |
| 23 | Структура затрат при различных методах управления риском | ПК-4.У.1 |
| 24 | Анализ эффективности методов управления риском | ПК-4.В.1 |
| 25 | Производственный риск | ПК-3.3.1 |
| 26 | Финансовый риск | ПК-4.3.1 |
| 27 | Инвестиционный риск | ПК-4.У.1 |
| 28 | Технологии учета риска проекта | ПК-4.В.1 |
| 29 | Управление рисками в промышленности | ПК-4.3.1 |
| 30 | Практика страхования инвестиционных рисков. | ПК-4.У.1 |

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 | В какое время риск становится объектом внимания и изучения ученых и | ПК-3.3.1 |

| | | |
|----|---|----------|
| | <p>предпринимателей:</p> <p>а) Новое время б) Средние века в) XX век</p> | |
| 2 | <p>Кто сумел оценить численность населения Лондона с помощью техники статистического заключения:</p> <p>а) Э. Ллойд б) Д. Бернулли в) Д. Граунт</p> | ПК-4.3.1 |
| 3 | <p>Как называется документ - свод данных корабельного дела, предоставляемых сетью европейских корреспондентов:</p> <p>а) Свод Гальтона б) Журнал Миля в) Регистр Ллойда</p> | ПК-4.У.1 |
| 4 | <p>Английский математик и астроном, который показал, как рассчитать стоимость страхового возмещения на основе данных об ожидаемой продолжительности жизни и возрасте страхователя:</p> <p>а) Ф. Гальтон б) Дж.М. Кейнс в) Э. Галлей</p> | ПК-4.В.1 |
| 5 | <p>Математик, открывший "Закон Больших Чисел":</p> <p>а) Д. Бернулли б) А. де Муавр в) Я. Бернулли</p> | ПК-3.3.1 |
| 6 | <p>Кто ввел понятия нормального распределения и среднеквадратического отклонения:</p> <p>а) Ф. Гальтон б) Г. Марковип в) А. де Муавр</p> | ПК-4.3.1 |
| 7 | <p>Кто открыл явление регрессии в 1885 году:</p> <p>а) Ф. Гальтон б) Д. Бернулли в) А. де Муавр</p> | ПК-4.У.1 |
| 8 | <p>Кому из ученых принадлежит работа "Теория игр и экономического поведения":</p> <p>а) Д. фон Нейман. О. Моргенштерн б) Ф. Блэк. М. Шоулз в) Найт. Миль. Сениор</p> | ПК-4.В.1 |
| 9 | <p>Кто предложил диверсификацию инвестиций, как метод сокращения риска потери прибыли:</p> <p>а) Ф. Гальтон б) Г. Марковиц в) А. де Муавр</p> | ПК-3.3.1 |
| 10 | <p>Какая команда ученых опубликовала математическую модель расчета стоимости опциона:</p> <p>а) Д. фон Нейман. О. Моргенштерн</p> | ПК-4.3.1 |

| | | |
|----|--|----------|
| | <p>б) Ф. Блэк. М. Шоулз в) Найт. Миль. Сениор</p> | |
| 11 | <p>Какие три типа риска в предпринимательской сфере выделил Дж. М. Кейнс:</p> <p>а) Предпринимательский риск (риск заемщика) б) Риск кредитора в) Риск недополучения прибыли г) Риск инфляции д) Риск потери доли рынка</p> | ПК-4.У.1 |
| 12 | <p>Объектами управления риском могут быть:</p> <p>а) выявленные риски б) невыявленные и неосознанные риски в) все ответы верны</p> | ПК-4.В.1 |
| 13 | <p>В каком случае уместно использование априорного подхода к определению вероятности?</p> <p>а) Возможные неопределенные результаты известны и равновероятны б) Вероятность определяется только лишь как степень уверенности в наступлении события в) На основании наблюдений оценивается относительная частота наступления событий</p> | ПК-3.3.1 |
| 14 | <p>В каком случае уместно использование эмпирического подхода к определению вероятности?</p> <p>а) Возможные неопределенные результаты известны и равновероятны б) Вероятность определяется только лишь как степень уверенности в наступлении события в) На основании наблюдений оценивается относительная частота наступления событий</p> | ПК-4.3.1 |
| 15 | <p>В каком случае уместно использование субъективного подхода к определению вероятности?</p> <p>а) Возможные неопределенные результаты известны и равновероятны б) Вероятность определяется только лишь как степень уверенности в наступлении события в) На основании наблюдений оценивается относительная частота наступления событий</p> | ПК-4.У.1 |
| 16 | <p>Какой из перечисленных методов оценки риска основан на расчетах и анализе статистических показателей?</p> <p>а) вероятностный метод б) построение дерева решений в) метод сценариев и анализ чувствительности г) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости имитационное моделирование</p> | ПК-4.В.1 |
| 17 | <p>Какой из перечисленных методов оценки риска дает представление о наиболее критических факторах инвестиционного проекта?</p> | ПК-3.3.1 |

| | | |
|----|--|----------|
| | <p>а) построение дерева решений б) метод сценариев в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости г) вероятностный метод д) анализ чувствительности имитационное моделирование</p> | |
| 18 | <p>Какой из перечисленных методов оценки риска реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков? а) построение дерева решений б) метод сценариев в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости г) анализ чувствительности д) вероятностный метод имитационное моделирование</p> | ПК-4.3.1 |
| 19 | <p>Какой из перечисленных методов оценки риска используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий? а) имитационное моделирование б) вероятностный метод в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости г) построение дерева решений д) анализ чувствительности метод сценариев</p> | ПК-4.У.1 |
| 20 | <p>Какой из перечисленных методов оценки риска представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты? а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости б) анализ чувствительности в) построение дерева решений г) вероятностный метод д) метод сценариев имитационное моделирование</p> | ПК-4.В.1 |
| 21 | <p>Каким образом при расчете чистой приведенной стоимости можно учитывать риск? а) в знаменателе формулы NPV посредством корректировки ставки дисконта б) комбинация формул NPV посредством корректировки чистых денежных потоков в) все варианты верны г) в числителе формулы NPV посредством корректировки чистых денежных потоков</p> | ПК-3.3.1 |
| 22 | <p>Что является субъектом управления в риск-менеджменте? а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками б) все варианты верны в) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами</p> | ПК-4.3.1 |

| | | |
|----|--|----------|
| 23 | <p>Что является объектом управления в риск-менеджменте?</p> <p>а) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами</p> <p>б) все варианты верны</p> <p>специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками</p> | ПК-4.У.1 |
| 24 | <p>Утверждение о том, что «деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» отражает смысл...</p> <p>а) закона неизбежности риска</p> <p>б) закона сочетания потенциальных потерь и выгод</p> <p>закон прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов</p> | ПК-4.В.1 |
| 25 | <p>Утверждение о том, что «практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» отражает смысл...</p> <p>а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов</p> <p>б) закона неизбежности риска</p> <p>закон сочетания потенциальных потерь и выгод</p> | ПК-3.3.1 |
| 26 | <p>Утверждение о том, что «чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» отражает смысл...</p> <p>а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов</p> <p>б) закона неизбежности риска</p> <p>закон сочетания потенциальных потерь и выгод</p> | ПК-4.3.1 |
| 27 | <p>К какой группе методов управления рисками относится прогнозирование внешней обстановки?</p> <p>а) методы компенсации рисков</p> <p>б) методы уклонения от рисков</p> <p>в) методы локализации рисков</p> <p>методы диверсификации рисков</p> | ПК-4.У.1 |
| 28 | <p>К какой группе методов управления рисками относится страхование?</p> <p>а) методы уклонения от рисков</p> <p>б) методы диверсификации рисков</p> <p>в) методы локализации рисков</p> <p>методы компенсации рисков</p> | ПК-4.В.1 |
| 29 | <p>К какой группе методов управления рисками относится распределение риска по этапам работы?</p> <p>а) методы локализации рисков</p> <p>б) методы компенсации рисков</p> <p>в) методы уклонения от рисков</p> <p>методы диверсификации рисков</p> | ПК-4.3.1 |
| 30 | <p>К какой группе методов управления рисками относится заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов?</p> <p>а) методы диверсификации рисков</p> <p>б) методы уклонения от рисков</p> | ПК-4.У.1 |

| | | |
|----|--|----------|
| | <p>в) методы компенсации рисков г) методы локализации рисков</p> | |
| 31 | <p>К какой группе методов управления рисками относится обучение и инструктирование персонала? а) методы уклонения от рисков б) методы компенсации рисков в) методы диверсификации рисков методы локализации рисков</p> | ПК-3.3.1 |
| 32 | <p>К какой группе методов управления рисками относится распределение ответственности между участниками проекта? а) методы диверсификации рисков б) методы компенсации рисков в) методы локализации рисков методы уклонения от рисков</p> | ПК-4.3.1 |
| 33 | <p>К какой группе методов управления рисками относится увольнение некомпетентных сотрудников? а) методы локализации рисков б) методы диверсификации рисков в) методы уклонения от рисков методы компенсации рисков</p> | ПК-4.У.1 |
| 34 | <p>К какой группе методов управления рисками относится создание системы резервов? а) методы уклонения от рисков б) методы диверсификации рисков в) методы компенсации рисков методы локализации рисков</p> | ПК-4.В.1 |
| 35 | <p>К какой группе методов управления рисками относится создание специальных инновационных подразделений? а) методы локализации рисков б) методы диверсификации рисков в) методы компенсации рисков методы уклонения от рисков</p> | ПК-3.3.1 |
| 36 | <p>К какой группе методов управления рисками относится распределение инвестиций в разных отраслях и сферах деятельности? а) методы диверсификации рисков б) методы локализации рисков в) методы компенсации рисков методы уклонения от рисков</p> | ПК-4.3.1 |
| 37 | <p>Риск – это... а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера</p> | ПК-4.У.1 |
| 38 | <p>Отметьте потери, которые можно отнести к трудовым: а) потери рабочего времени б) уменьшение выручки вследствие снижения цен на</p> | ПК-4.В.1 |

| | | |
|----|--|----------|
| | <p>реализуемую продукцию</p> <p>в) уплата дополнительных налогов</p> <p>г) ущерб здоровью</p> <p>потери сырья</p> | |
| 39 | <p>Отметьте потери, которые можно отнести к финансовым</p> <p>а) потери ценных бумаг</p> <p>б) потери сырья</p> <p>в) невыполнение сроков сдачи объекта</p> <p>г) выплата штрафа</p> <p>д) уплата дополнительных налогов</p> <p>ущерб репутации</p> | ПК-3.3.1 |
| 40 | <p>Отметьте потери, которые можно отнести к потерям времени</p> <p>а) невыполнение сроков сдачи объекта</p> <p>б) потери ценных бумаг</p> <p>в) выплата штрафа</p> <p>г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию</p> <p>потери материалов</p> | ПК-4.3.1 |
| 41 | <p>Отметьте потери, которые можно отнести к специальным потерям</p> <p>а) выплата штрафа</p> <p>б) ущерб здоровью</p> <p>в) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию</p> <p>г) уплата дополнительных налогов</p> <p>ущерб репутации</p> | ПК-4.У.1 |
| 42 | <p>Анализ риска – это...</p> <p>а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия</p> <p>б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты</p> <p>начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик</p> | ПК-4.В.1 |
| 43 | <p>Идентификация риска – это...</p> <p>а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия</p> <p>б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик</p> <p>систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты</p> | ПК-3.3.1 |
| 44 | <p>Риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль, называются</p> <p>а) чистыми</p> <p>б) критическими</p> <p>спекулятивными</p> | ПК-4.3.1 |
| 45 | <p>Последствия риска могут быть</p> <p>а) скорее положительными</p> | ПК-4.У.1 |

| | | |
|----|--|----------|
| | б) как положительными, так и отрицательными только отрицательными | |
| 46 | Риски, которые практически всегда несут в себе потери, называются а) критическими б) спекулятивными чистыми | ПК-4.В.1 |
| 47 | Риски, обусловленные деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией, называются а) внешними б) внутренними чистыми | ПК-3.3.1 |
| 48 | Риски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря прибыли, называются а) катастрофическими б) критическими допустимыми | ПК-4.3.1 |
| 49 | Риски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря выручки (т.е. потери превышают ожидаемую прибыль), называются а) катастрофическими б) критическими допустимыми | ПК-4.У.1 |
| 50 | Чем измеряется величина или степень риска? а) средним ожидаемым значение б) изменчивостью возможного результата оба варианта верны | ПК-4.В.1 |
| 51 | Социально-экономическая функция риска состоит а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике - отрасли деятельности, в которых риск приемлем б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода оба варианта верны | ПК-3.3.1 |
| 52 | Компенсирующая функция риска состоит а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике - отрасли деятельности, в которых риск приемлем б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода оба варианта верны | ПК-4.3.1 |
| 53 | Защитная функция риска состоит а) в объективной необходимости законодательного закрепления понятия "правомерности риска", правового регулирования страховой деятельности б) в том, что юридические и физические лица вынуждены искать средства и формы защиты от нежелательной реализации риска оба варианта верны | ПК-4.У.1 |
| 54 | Стимулирующая функция риска проявляется | ПК-4.В.1 |

| | | |
|----|--|----------|
| | <p>а) в том, что реализация решений с неисследованным или необоснованным риском может приводить к реализации объектов или операций, которые относятся к авантюрным</p> <p>б) в исследовании источников риска при проектировании операций и систем, конструировании специальных устройств, операций, форм сделок, исключая или снижающих возможные последствия риска как отрицательного отклонения</p> <p>в) оба варианта верны</p> | |
| 55 | <p>Ущерб имуществу изначально выражается в...</p> <p>а) натуральном виде</p> <p>б) оба варианта верны</p> <p>денежной форме</p> | ПК-3.3.1 |
| 56 | <p>Денежная форма ущерба называется</p> <p>а) убытком</p> <p>б) упущенной выгодой</p> <p>финансовыми потерями</p> | ПК-4.3.1 |
| 57 | <p>Отметьте потери, которые можно отнести к материальным</p> <p>а) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию</p> <p>б) невыполнение сроков сдачи объекта</p> <p>в) потери рабочего времени</p> <p>г) потери материалов</p> <p>д) уплата дополнительных налогов</p> <p>е) выплата штрафа</p> <p>ж) потери сырья</p> <p>потери ценных бумаг</p> | ПК-4.У.1 |
| 58 | <p>Систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия называется</p> <p>а) идентификацией рисков</p> <p>б) анализом рисков</p> <p>классификацией рисков</p> | ПК-4.В.1 |

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

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:

- Общие принципы управления рисками
 - Риск как предмет управления и исследования
 - Базовые концепции и определения
 - Управление рисками как группа процессов предприятия
 - Основные стандарты управления рисками в РФ
- Планирование управления рисками
 - Входы процесса
 - Инструменты и методы
 - Выходы процесса
- Идентификация рисков
 - Входы процесса идентификации рисков
 - Инструменты и методы процесса
 - Выходы процесса идентификации рисков
- Качественный анализ рисков
 - Входы процесса качественного анализа рисков
 - Инструменты и методы
 - Выходы процесса качественного анализа рисков
- Количественный анализ рисков
 - Входы процесса количественного анализа рисков
 - Инструменты и методы процесса
 - Выходы процесса количественного анализа рисков
- Планирование реагирования на риски
 - Входы процесса
 - Инструменты и методы
 - Выходы процесса
- Мониторинг и управление рисками

- Входы процесса мониторинга и управления рисками
- Инструменты и методы
- Выходы процесса мониторинга и управления рисками

Методические указания по освоению лекционного материала имеются в в виде электронного ресурса, URL адрес: <https://tushavin.ru/wp-content/uploads/2022/08/MISOR.pdf>

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

11.3. Методические указания для обучающихся по прохождению практических занятий

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

Задание к выполнению лабораторной работы выдается преподавателем в начале занятия в соответствии с планом занятий. Темы практических занятий приведены в табл. 5 данной программы.

Требования к оформлению отчета о практической работе

Титульный лист отчета должен соответствовать шаблону, приведенному в секторе нормативной документации ГУАП <https://guap.ru/standart/doc>

Оформление основной части отчета должно быть оформлено в соответствии с ГОСТ 7.32-2017. Требования приведены в секторе нормативной документации ГУАП <https://guap.ru/standart/doc>

При формировании списка источников студентам необходимо руководствоваться требованиями стандарта ГОСТ 7.0.100-2018. Примеры оформления списка источников приведены в секторе нормативной документации ГУАП. <https://guap.ru/standart/doc>

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

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

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).

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.

Текущий контроль осуществляется в соответствии с требованиями СТО ГУАП. СМК 3.76 «Положение о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов и аспирантов ГУАП, обучающихся по образовательным программам высшего образования» и МДО ГУАП. СМК 2.77 «Положение о модульно-рейтинговой системе оценки качества учебной работы студентов в ГУАП» (https://guap.ru/quality/lna_vo).

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:

- 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».

В течение семестра для допуска к зачету студенту необходимо сдать не менее 60% практических работ, представить отчет по контрольной работе. Далее студент допускается к собеседованию или итоговому тестированию на зачете.

Зачет выставляется на основании выполненных в течение семестра трех практических работ и прохождения собеседования.

Система оценок при проведении текущего контроля и промежуточной аттестации осуществляется в соответствии с руководящим документом организации РДО ГУАП. СМК 3.76 «Положение о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации студентов и аспирантов, обучающихся по образовательным программам высшего образования в ГУАП» https://docs.guap.ru/guap/2020/sto_smk-3-76.pdf.

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