

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Иркутский государственный университет путей сообщения»

Красноярский институт железнодорожного транспорта

– филиал Федерального государственного бюджетного образовательного учреждения
высшего образования «Иркутский государственный университет путей сообщения»
(КриЖТ ИрГУПС)

УТВЕРЖДЕНА

приказ ректора

от «08» мая 2020 г. № 268-1

**Б1.В.14 Проектирование систем управления рисками
хозяйствующих субъектов**
рабочая программа дисциплины

Направление подготовки – 38.03.01 Экономика

Профиль подготовки – Экономическая безопасность, анализ и управление рисками

Программа подготовки – академический бакалавриат

Квалификация выпускника – бакалавр

Форма обучения – заочная

Нормативный срок обучения – 5 лет

Кафедра-разработчик программы – Управление персоналом

Общая трудоемкость в з.е. – 5

Формы промежуточной аттестации, курс:

Часов по учебному плану – 180

курсовая работа – 5, экзамен – 5

Распределение часов дисциплины по курсам

| Курс | 5 | Итого часов по учебному плану |
|--|-------------------------|-------------------------------|
| Вид занятий | Часов по учебному плану | |
| Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий | 20 | 20 |
| – лекции | 10 | 10 |
| – практические (семинарские) | 10 | 10 |
| Самостоятельная работа | 142 | 142 |
| Экзамен | 18 | 18 |
| Итого | 180 | 180 |

КРАСНОЯРСК

Электронный документ выгружен из ЕИС ФГБОУ ВО ИрГУПС и соответствует оригиналу

Подписант ФГБОУ ВО ИрГУПС Трофимов Ю.А.

00920FD815CE68F8C4CA795540563D259C с 07.02.2024 05:46 по 02.05.2025 05:46 GMT+03:00

Подпись соответствует файлу документа



Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата), утвержденным Приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12 ноября 2015 г. № 1327.

Программу составил:
канд. экон. наук, доцент

А.А. Малахова

Рабочая программа дисциплины обсуждена и рекомендована к применению в образовательном процессе для обучения обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика на заседании кафедры «Управление персоналом».
Протокол от «12» марта 2020 г. № 8

Зав. кафедрой, канд. тех. наук, доцент

В.О. Колмаков

| ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ | |
|--|---|
| 1.1 Цели освоения дисциплины | |
| 1 | Формирование у обучающихся навыков интегрированного восприятия рисков с целью выбора оптимальных системных мер по сокращению возможных ущербов и обеспечению экономической безопасности хозяйствующих субъектов |
| 1.2 Задачи освоения дисциплины | |
| 1 | Формирование у обучающихся способностей анализа рисков на основе применения системного подхода – путем выявления элементов, подверженных рискам, и связей между этими элементами; |
| 2 | Формирование у обучающихся навыков применения решений интегрированного риск-менеджмента; |
| 3 | Формирование у обучающихся навыков построения моделей управления рисками на основе применения системного подхода. |

| 1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины | |
|---|--|
| Научно-образовательное воспитание обучающихся | |
| <p>Цель научно-образовательного воспитания – создание условий для реализации научно-образовательного потенциала обучающихся в форме наставничества, тьюторства, научного творчества.</p> <p>Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:</p> <ul style="list-style-type: none"> – формирование системного и критического мышления, мотивации к обучению, развитие интереса к творческой научной деятельности; – создание в студенческой среде атмосферы взаимной требовательности к овладению знаниями, умениями и навыками; – популяризация научных знаний среди обучающихся; – содействие повышению привлекательности науки, поддержка научно-технического творчества; – создание условий для получения обучающимися достоверной информации о передовых достижениях и открытиях мировой и отечественной науки, повышения заинтересованности в научных познаниях об устройстве мира и общества; – совершенствование организации и планирования самостоятельной работы обучающихся как образовательной технологии формирования будущего специалиста путем индивидуальной познавательной и исследовательской деятельности <p>Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:</p> <ul style="list-style-type: none"> – формирование системного и критического мышления, мотивации к обучению, развитие интереса к творческой научной деятельности; – создание в студенческой среде атмосферы взаимной требовательности к овладению знаниями, умениями и навыками; – популяризация научных знаний среди обучающихся; – содействие повышению привлекательности науки, поддержка научно-технического творчества; – создание условий для получения обучающимися достоверной информации о передовых достижениях и открытиях мировой и отечественной науки, повышения заинтересованности в научных познаниях об устройстве мира и общества; – совершенствование организации и планирования самостоятельной работы обучающихся как образовательной технологии формирования будущего специалиста путем индивидуальной познавательной и исследовательской деятельности. | |
| Профессионально-трудовое воспитание обучающихся | |
| <p>Цель профессионально-трудового воспитания – формирование у обучающихся осознанной профессиональной ориентации, понимания общественного смысла труда и значимости его для себя лично, ответственного, сознательного и творческого отношения к будущей деятельности, профессиональной этики, способности предвидеть изменения, которые могут возникнуть в профессиональной деятельности, и умению работать в изменённых, вновь созданных условиях труда.</p> <p>Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:</p> <ul style="list-style-type: none"> – формирование сознательного отношения к выбранной профессии; – воспитание чести, гордости, любви к профессии, сознательного отношения к профессиональному долгу, понимаемому как личная ответственность и обязанность; – формирование психологи профессионала; – формирование профессиональной культуры, этики профессионального общения; – формирование социальной компетентности и другие задачи, связанные с имиджем профессии и авторитетом транспортной отрасли | |

| 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП | |
|--|---|
| 2.1 Требования к предварительной подготовке обучающегося: | |
| 1 | Б1.Б.08 Линейная алгебра |
| 2 | Б1.Б.10 Методы оптимальных решений |
| 3 | Б1.Б.13 Эконометрика |
| 4 | Б1.В.ДВ.08.02 Финансовое прогнозирование |
| 5 | Б1.В.ДВ.09.02 Оценка экономической безопасности |
| 6 | Б1.В.06 Теория и методология анализа рисков |

| | |
|---|--|
| 7 | Б1.В.ДВ.06.01 Система обеспечения экономической безопасности организации |
| 8 | Б1.В.08 Методология и практика обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов |
| 9 | Б1.В.ДВ.07.01 Управление рисками |
| 10 | Б1.В.12 Теоретические основы экономической безопасности хозяйствующих субъектов |
| 2.2 Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: | |
| 1 | Б1.В.15 Управление финансовыми (страховыми, налоговыми и иными) рисками в системе экономической безопасности |
| 2 | Б1.В.09 Теневая экономика и экономическая безопасность |
| 3 | Б3.Б.01 Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты |

ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

ПК-4: способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты

Минимальный уровень освоения компетенции

| | |
|---------|---|
| Знать | принципы организации сбора информации в системе управления рисками |
| Уметь | анализировать информацию отчетности предприятий и организация с целью подготовки решений при управлении рисками |
| Владеть | навыками описания организации как объекта управления, навыками практического применения законов и принципов организации, методами анализа информации в системе управления рисками |

Базовый уровень освоения компетенции

| | |
|---------|--|
| Знать | принципы организации сбора и обработки информации в системе управления рисками |
| Уметь | анализировать и интерпретировать информацию отчетности предприятий и организация с целью подготовки решений при управлении рисками |
| Владеть | навыками определения и классификации функций конкретной организации, их распределения между ее отдельными структурными подразделениями, приемами и методами анализа информации в системе |

Высокий уровень освоения компетенции

| | |
|---------|--|
| Знать | принципы организации сбора, обработки и хранения информации в системе управления рисками |
| Уметь | анализировать, интерпретировать и представлять информацию отчетности предприятий и организация с целью подготовки решений при управлении рисками |
| Владеть | навыками выявления организационных патологий и разработки мер по их предупреждению; способностью управлять организационными изменениями; навыками применения моделей и методов интегрированного риск-менеджмента, приемами и методами анализа информации в системе управления рисками, способами использования информации для выработки решений при управлении рисками |

ДПК-5.1: способностью применять модели и методы анализа и оценки рисков в экономических расчетах

Минимальный уровень освоения компетенции

| | |
|---------|--|
| Знать | основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих деятельность предприятия железнодорожного транспорта, и оценки рисков в экономических расчетах |
| Уметь | осуществлять поиск информации по полученному заданию, сбор, анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач и оценки рисков в экономических расчетах |
| Владеть | основами построения на основе описания ситуаций стандартных теоретических и эконометрических моделей оценки рисков в экономических расчетах |

Базовый уровень освоения компетенции

| | |
|---------|---|
| Знать | методы построения моделей, характеризующих деятельность предприятия железнодорожного транспорта, и оценки рисков в экономических расчетах |
| Уметь | осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей |
| Владеть | современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей, характеризующих экономические процессы предприятия железнодорожного транспорта, и оценки рисков в экономических расчетах |

Высокий уровень освоения компетенции

| | |
|-------|---|
| Знать | методы построения моделей объектов, процессов и явлений, их прогнозирования и оценки рисков в экономических расчетах |
| Уметь | строить на основе описания ситуаций стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты, оценивать риски в экономических расчетах |

| | |
|---|---|
| Владеть | современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей, характеризующих экономические процессы предприятия железнодорожного транспорта, и оценки рисков в экономических расчетах |
| ДПК-5.2: способностью аргументировать выбор алгоритмов противодействия рискам в системе обеспечения экономической безопасности | |
| Минимальный уровень освоения компетенции | |
| Знать | понятие и принципы управления рисками |
| Уметь | применять основы системного подхода к управлению рисками для обеспечения экономической |
| Владеть | навыками описания организации как объекта управления, навыками практического применения законов и принципов организации |
| Базовый уровень освоения компетенции | |
| Знать | понятие и принципы управления рисками, принципы проектирования систем управления рисками |
| Уметь | проектировать алгоритм противодействия рискам в системе обеспечения экономической безопасности, систематизировать аналитические данные для построения алгоритмов управления рисками |
| Владеть | навыками определения и классификации функций конкретной организации, их распределения между ее отдельными структурными подразделениями |
| Высокий уровень освоения компетенции | |
| Знать | понятие и принципы управления рисками, принципы проектирования систем управления рисками, подходы к стандартизации систем риск-менеджмента |
| Уметь | проектировать алгоритма противодействия рискам и организовывать процесс принятия решений в системе обеспечения экономической безопасности |
| Владеть | навыками выявления организационных патологий и разработки мер по их предупреждению; способностью управлять организационными изменениями, противодействовать рискам и организовывать процесс принятия решений в системе обеспечения экономической безопасности |

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

| | |
|----------------|---|
| Знать | |
| 1 | основы системного подхода к управлению рисками для обеспечения экономической безопасности |
| Уметь | |
| 1 | систематизировать аналитические данные для построения алгоритмов управления рисками хозяйствующего субъекта |
| Владеть | |
| 1 | навыками применения моделей и методов интегрированного риск-менеджмента |

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

| Код занятия | Наименование разделов и тем /вид занятия/ | Курс | Часы | Код компетенции | Учебная литература, ресурсы сети «Интернет» |
|-------------|--|------|------|----------------------------|---|
| 1.0 | Раздел 1 Общая методология проектирования систем управления рисками | | | | |
| 1.1 | Понятие и особенности управления рисками /Лек/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.2 | Понятие и особенности управления рисками /Пр/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.3 | Понятие и особенности управления рисками /Ср/ | 5 | 8 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.4 | Системы управления рисками /Лек/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.5 | Системы управления рисками /Пр/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.6 | Системы управления рисками /Ср/ | 5 | 8 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.7 | Информация в системе управления рисками /Лек/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.8 | Информация в системе управления рисками /Пр/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |

| | | | | | |
|------|---|---|----|----------------------------|---|
| 1.9 | Информация в системе управления рисками /Ср/ | 5 | 8 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.10 | Система управления проектными рисками /Лек/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.11 | Система управления проектными рисками /Пр/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 1.12 | Система управления проектными рисками /Ср/ | 5 | 12 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.0 | Раздел 2 Проектирование систем управления конкретными рисками в общей системе обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов | 5 | | | |
| 2.1 | Моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками /Лек/ | 5 | 2 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.2 | Моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками /Пр/ | 5 | 2 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.3 | Моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками /Ср/ | 5 | 12 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.4 | Особенности финансовых рисков предприятия. Модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности. Модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия /Лек/ | | 2 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.5 | Особенности финансовых рисков предприятия. Модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности. Модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия /Пр/ | 5 | 2 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.6 | Особенности финансовых рисков предприятия. Модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности. Модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия /Ср/ | 5 | 12 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.7 | Организация управления рисками. Подходы к стандартизации систем риск-менеджмента. Регламенты управления рисками /Лек/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.8 | Организация управления рисками. Подходы к стандартизации систем риск-менеджмента. Регламенты управления рисками /Пр/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.9 | Организация управления рисками. Подходы к стандартизации систем риск-менеджмента. Регламенты управления рисками /Ср/ | 5 | 12 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.10 | Оценка состояния защищенности объекта транспортной инфраструктуры и транспортных средств и соответствия реализуемых мер угрозам совершения актов незаконного вмешательства /Лек/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.11 | Оценка состояния защищенности объекта транспортной инфраструктуры и транспортных средств и соответствия реализуемых мер угрозам совершения актов незаконного вмешательства /Пр/ | 5 | 1 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 2.12 | Оценка состояния защищенности объекта транспортной инфраструктуры и транспортных средств и соответствия реализуемых мер угрозам совершения актов незаконного вмешательства /Ср/ | 5 | 12 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |

| | | | | | |
|-----|----------------------|---|----|----------------------------|---|
| 3.0 | Курсовая работа /Ср/ | 5 | 58 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | 6.1.1.1, 6.1.2.1- 6.1.2.5, 6.2.1-6.2.6 |
| 4.0 | Экзамен | 5 | 18 | ПК-4 ДПК-5.1 ДПК-5.2 | |

**5 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ
ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ
АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ**

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине разработан в соответствии с Положением о формировании фондов оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной и государственной итоговой аттестации.

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по данной дисциплине представлен в приложении № 1 к рабочей программе дисциплины и размещен в электронной информационно-образовательной среде КрИЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1 Учебная литература

6.1.1 Основная литература

| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год издания | Кол-во экз. в библиотеке/ 100% online |
|---------|---|--|------------------------------|---|
| 6.1.1.1 | Авдийский В.И. Безденежных В.М. Дадалко А.В. Земсков В.В. Синявский. Н.Г. | Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учеб. пособие [Электронный ресурс]. – https://znanium.com/catalog/product/1863267 | Москва : ИНФРА-М, 2022 | 100% online |

6.1.2. Дополнительная литература

| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год издания | Кол-во экз. в библиотеке/ 100% online |
|---------|---|---|---|---|
| 6.1.2.1 | Хоминич И. П. | Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов [Электронный ресурс]. – https://urait.ru/bcode/536964 | Москва : Издательство Юрайт, 2024 | 100% online |
| 6.1.2.2 | Серебрякова Т. Ю. | Риски организации и внутренний экономический контроль : монография [Электронный ресурс]. – https://znanium.com/catalog/product/1031520 | Москва : ИНФРА-М, 209 | 100% online |
| 6.1.2.3 | Царьков И.Н.; введение Аньшина В.М. | Математические модели управления проектами : учебник [Электронный ресурс]. – https://znanium.com/catalog/product/2013668 | Москва : ИНФРА-М, 2024 | 100% online |
| 6.1.2.4 | Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С | Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие [Электронный ресурс]. – https://znanium.com/catalog/product/2084842 | Москва : Дашков и К, 2023 | 100% online |
| 6.1.2.5 | Антонов Г.Д., Иванова О.П., Тумин В.М. | Управление рисками организации: Учебное пособие [Электронный ресурс]. – https://znanium.com/catalog/product/1897324 | Москва : НИЦ ИНФРА-М, 2023 | 100% online |

6.1.3. Методические разработки

| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год издания | Кол-во экз. в библиотеке/ 100% online |
|--|------------------------|----------|------------------------------|---|
| | | | | |

6.1.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год издания | Кол-во экз. в библиотеке/ 100% online |
|--|------------------------|----------|------------------------------|---|
| | | | | |

| | | | | |
|---------|-----------------|---|---------------------------------|--------------|
| 6.1.4.1 | Малахова, А. А. | Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов: методические материалы и указания по изучению дисциплины для обучающихся направления подготовки 38.03.01 "Экономика", профиль "Экономическая безопасность, анализ и управление рисками" [Электронный ресурс]. – http://irbis.krsk.irkups.ru/web_ft/index.php?C21COM=S&S21COLORTERMS=1&P21DBN=IBIS&I21DBN=IBIS_FULLTEXT&LNG=&Z21ID=4444&S21FMT=briefHTML_ft&USES21ALL=1&S21ALL=%28%3C%2E%3E%3D005%2E3%2F%D0%9C%2018%2D556589776%3C%2E%3E%29&FT_PREFIX=K&T=&SEARCH_STRING=&S21STN=1&S21REF=10&S21CNR=5&auto_open=4 | Красноярск : КрИЖТ ИрГУПС, 2023 | 100 % online |
|---------|-----------------|---|---------------------------------|--------------|

6.2 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

| | |
|-------|---|
| 6.2.1 | Библиотека КрИЖТ ИрГУПС : [сайт] / Красноярский институт железнодорожного транспорта – филиал ИрГУПС. – Красноярск. – URL: http://irbis.krsk.irkups.ru/ . – Режим доступа: после авторизации. – Текст : электронный. |
| 6.2.2 | Электронная библиотека «УМЦ ЖДТ» : электронно-библиотечная система : сайт / ФГБУ ДПО «Учебно-методический центр по образованию на железнодорожном транспорте». – Москва, 2013 – 2024. – URL: http://umcздт.ru/books/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный. |
| 6.2.3 | Znanium : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «ЗНАНИУМ». – Москва. 2011 – 2024. – URL: http://znanium.ru . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный. |
| 6.2.4 | Образовательная платформа Юрайт : электронная библиотека : сайт / ООО «Электронное издательство Юрайт». – Москва, 2020. – URL: https://urait.ru/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный. |
| 6.2.5 | Университетская библиотека онлайн : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «Директ-Медиа». – Москва, 2001 – 2024. – URL: https://biblioclub.ru/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный. |
| 6.2.6 | Красноярский институт железнодорожного транспорта : [электронная информационно-образовательная среда] / Красноярский институт железнодорожного транспорта. – Красноярск. – URL: http://sdo1.krsk.irkups.ru/ . – Текст : электронный. |
| 6.2.7 | Национальная электронная библиотека : федеральный проект : сайт / Министерство Культуры РФ. – Москва, 2014 – 2024. – URL: https://rusneb.ru/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный. |
| 6.2.8 | Российские железные дороги : официальный сайт / ОАО «РЖД». – Москва, 2003 – 2024. – URL: https://company.rzd.ru/ . – Текст : электронный. |

6.3 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

6.3.1 Перечень базового программного обеспечения

| | |
|---------|--|
| 6.3.1.1 | Microsoft Windows Vista Business Russian, авторизационный номер лицензиата 64787976ZZS1011, номер лицензии 44799789. Microsoft Office Standard 2013 Russian OLP NL Academic Edition (дог №2 от 29.05.2014 – 100 лицензий; дог №0319100020315000013-00 от 07.12.2015 – 87 лицензий). |
|---------|--|

6.3.2 Перечень специализированного программного обеспечения

| | |
|--|-----------------|
| | Не используется |
|--|-----------------|

6.3.3 Перечень информационных справочных систем

| | |
|---------|--|
| 6.3.3.1 | Гарант [Электронный ресурс] : справочно-правовая система. – Режим доступа : из локальной сети |
| 6.3.3.2 | Автоматизированная система правовой информации на железнодорожном транспорте (БД АСПИЖТ) : сайт КонсультантПлюс / АО НИИАС. – Режим доступа : из локальной сети вуза. – Текст : электронный. |

6.4 Правовые и нормативные документы

| | |
|-------|-----------------|
| 6.4.1 | Не используется |
|-------|-----------------|

7 ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

| | |
|-----|--|
| 7.1 | Корпуса А, Т, Н, Л КрИЖТ ИрГУПС находятся по адресу г. Красноярск, ул. Новая Заря, д. 2И. |
| 7.2 | Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий практического типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, укомплектованные специализированной мебелью и техническими средствами обучения (ноутбук, проектор, экран), учебно-наглядные пособия (презентации), служащими для представления учебной информации большой аудитории. Помещения для проведения лабораторных занятий оснащены компьютерной техникой, подключенной к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду КрИЖТ ИрГУПС: – компьютерные классы А-409, Л-203, Т-46. |
| 7.3 | Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, подключенной к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду КрИЖТ ИрГУПС. |

| | |
|-----|--|
| | Помещения для самостоятельной работы обучающихся: – читальный зал библиотеки; – учебные аудитории А-409, Л-203, Т-46 |
| 7.4 | Помещение для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования А-307. |

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

| Вид учебной деятельности | Организация учебной деятельности обучающегося |
|--------------------------|---|
| Лекция | <p>Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, то необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии. Уделить внимание следующим понятиям и вопросам:</p> <ul style="list-style-type: none"> - понятие и особенности управления рисками; - системы управления рисками; - моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками; - особенности финансовых рисков предприятия; - модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности; - модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия; - организация управления рисками; - подходы к стандартизации систем риск-менеджмента; - регламенты управления рисками; - оценка состояния защищенности объекта транспортной инфраструктуры и транспортных средств и соответствия реализуемых мер угрозам совершения актов незаконного вмешательства. |
| Практическое занятие | <p>Основным условием эффективного участия обучающихся в практическом занятии является проработка лекционного материала и вопросов, предусмотренных для самостоятельного изучения.</p> <p>При проведении практических занятий обучающийся должен быть обеспечен материалами (условиями) кейсов или ситуационных задач, если они предусмотрены планом занятия. А также тестовыми заданиями. Материалы могут быть размещены в электронной информационно-образовательной среде КрИЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.</p> |
| Самостоятельная работа | <p>Цели внеаудиторной самостоятельной работы:</p> <ul style="list-style-type: none"> – стимулирование познавательного интереса; – закрепление и углубление полученных знаний и навыков; – развитие познавательных способностей и активности студентов, самостоятельности, ответственности и организованности; – подготовка к предстоящим занятиям; – формирования самостоятельности мышления, способностей к саморазвитию, самосовершенствованию и самореализации; – формирование культуры умственного труда и самостоятельности в поиске и приобретении новых знаний и умений, и, в том числе, формирование компетенций. <p>Традиционные формы самостоятельной работы студентов следующие:</p> <ul style="list-style-type: none"> – работа с конспектом лекции, т.е. дополнение конспекта учебным материалом (учебника, учебного пособия, первоисточника, дополнительной литературы, нормативных документов и материалом электронного ресурса и сети Интернет); – чтение текста (учебника, учебного пособия, первоисточника, дополнительной литературы); – конспектирование текста (работа со справочниками, нормативными документами); – ответы на контрольные вопросы; – подготовка к практическому занятию; – подготовка к курсовой работе; – подготовка к экзамену; – подготовка к тестированию. |
| Курсовая работа | <p>Курсовая работа представляет собой конечный продукт, получаемый в результате планирования и выполнения комплекса учебных и исследовательских заданий. Курсовая работа позволяет оценить умения обучающихся самостоятельно конструировать свои знания в процессе решения практических задач и проблем, ориентироваться в информационном пространстве и уровень сформированности аналитических, исследовательских навыков, навыков практического и творческого мышления. Может быть использована для оценки умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся в предметной или межпредметной областях.</p> <p>Курсовая работа выполняется обучающимся самостоятельно и индивидуально по данным конкретного предприятия (предприятия, на материалах которого осуществляется реализация программы практик и последующее выполнение ВКР).</p> <p>Темы и типовые планы курсовых работ, а также рекомендации по ее выполнению, оформлению</p> |

| | |
|---|--|
| | <p>и подготовке к защите содержатся в специальных Методических указания, размещенных в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.</p> <p>После проверки выполнения курсовой работы она подлежит защите в форме ответа на устные вопросы, задаваемые преподавателем. При оценке курсовой работы учитывается ее содержание, соблюдение срока выполнения, оформление и уровень ответа на поставленные вопросы.</p> <p>При проведении промежуточной аттестации в форме курсовой работы используются результаты проведения защиты в виде собеседования по теме курсовой работы (устно).</p> <p>Оценочные средства и типовые контрольные задания текущего контроля позволяют оценить знания, умения и владения навыками/опытом деятельности обучающихся при освоении дисциплины. Оценочные средства включают: темы курсовых работ, типовые вопросы к защите.</p> |
| Экзамен | <p>Экзамен – это средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Допуском к экзамену являются результаты тестирования.</p> <p>Промежуточная аттестация – экзамен - проводится в виде собеседования по экзаменационному билету (устно). Билет включает два теоретических вопроса и одно практическое задание (ситуационная задача).</p> <p>Оценочные средства и типовые контрольные задания текущего контроля позволяют оценить знания, умения и владения навыками/опытом деятельности обучающихся при освоении дисциплины. Оценочные средства включают: вопросы к экзамену, типовые экзаменационные задачи.</p> <p>Задания, по которым проводятся контрольно-оценочные мероприятия, хранятся на кафедре-разработчике ФОС на бумажном носителе в составе ФОС по дисциплине.</p> |
| <p>Комплекс учебно-методических материалов по всем видам учебной деятельности, предусмотренным рабочей программой дисциплины, размещен в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет и Электронную библиотеку (ЭБ КриЖТ ИрГУПС) http://irbis.krsk.irkups.ru</p> | |

**Приложение 1 к рабочей программе по дисциплине
Б1.В.14 «Проектирование систем управления рисками
хозяйствующих субъектов»**

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
для проведения текущего контроля успеваемости
и промежуточной аттестации по дисциплине**

**Б1.В.14 Проектирование систем управления рисками
хозяйствующих субъектов**

1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Дисциплина Б1.В.14 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов участвует в формировании компетенций:

ПК-4: способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;

ДПК-5.1: способностью применять модели и методы анализа и оценки рисков в экономических расчетах;

ДПК-5.2: способностью аргументировать выбор алгоритмов противодействия рискам в системе обеспечения экономической безопасности.

**Таблица траекторий формирования у обучающихся компетенций ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2
при освоении образовательной программы
(заочная форма)**

| Код компетенции | Наименование компетенции | Индекс и наименование дисциплин, практик, участвующих в формировании компетенции | Курс изучения дисциплины | Этапы формирования компетенции |
|-----------------|---|--|--------------------------|--------------------------------|
| ПК-4 | способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты | Б1.Б.08 Линейная алгебра | 1 | 1 |
| | | Б1.Б.10 Методы оптимальных решений | 2 | 2 |
| | | Б1.Б.13 Эконометрика | 2 | 2 |
| | | Б1.В.ДВ.08.02 Финансовое прогнозирование | 4 | 3 |
| | | Б1.В.14 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов | 5 | 4 |
| | | Б3.Б.01 Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты | 5 | 4 |
| ДПК-5.1 | способностью применять модели и методы анализа и оценки рисков в экономических расчетах | Б1.В.06 Теория и методология анализа рисков | 3 | 1 |
| | | Б1.В.ДВ.09.02 Оценка экономической безопасности | 4 | 2 |
| | | Б1.В.12 Теоретические основы экономической безопасности хозяйствующих субъектов | 4 | 2 |
| | | Б1.В.09 Теневая экономика и экономическая безопасность | 4 | 2 |
| | | Б1.В.14 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов | 5 | 3 |
| | | Б3.Б.01 Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты | 5 | 3 |
| ДПК-5.2 | способностью аргументировать выбор алгоритмов противодействия рискам в системе обеспечения экономической безопасности | Б1.В.ДВ.06.01 Система обеспечения экономической безопасности организации | 4 | 1 |
| | | Б1.В.08 Методология и практика обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов | 4 | 1 |
| | | Б1.В.ДВ.07.01 Управление рисками | 4 | 1 |
| | | Б1.В.15 Управление финансовыми (страховыми, налоговыми и иными) рисками в системе экономической безопасности | 4 | 1 |
| | | Б1.В.14 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов | 5 | 2 |
| | | Б3.Б.01 Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты | 5 | 2 |

**Таблица соответствия уровней освоения компетенций ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2
планируемым результатам обучения**

| Код компетенции | Наименование компетенции | Наименования разделов/тем дисциплины | Уровни освоения компетенции | Планируемые результаты обучения (показатели достижения заданного уровня освоения компетенции) |
|-----------------|---|--------------------------------------|-----------------------------|---|
| ПК-4 | способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты | Разделы 1-2 | Минимальный уровень | Знать: принципы организации сбора информации в системе управления рисками |
| | | | | Уметь: анализировать информацию отчетности предприятий и организация с целью подготовки решений при управлении рисками |
| | | | | Владеть: навыками описания организации как объекта управления, навыками практического применения законов и принципов организации, методами анализа информации в системе управления рисками |
| | | | Базовый уровень | Знать: принципы организации сбора и обработки информации в системе управления рисками |
| | | | | Уметь: анализировать и интерпретировать информацию отчетности предприятий и организация с целью подготовки решений при управлении рисками |
| | | | | Владеть: навыками определения и классификации функций конкретной организации, их распределения между ее отдельными структурными подразделениями, приемами и методами анализа информации в системе управления рисками |
| | | | Высокий уровень | Знать: принципы организации сбора, обработки и хранения информации в системе управления рисками |
| | | | | Уметь: анализировать, интерпретировать и представлять информацию отчетности предприятий и организация с целью подготовки решений при управлении рисками |
| | | | | Владеть: навыками выявления организационных патологий и разработки мер по их предупреждению; способностью управлять организационными изменениями; навыками применения моделей и методов интегрированного риск-менеджмента, приемами и методами анализа информации в системе управления рисками, способами использования информации для выработки решений при управлении рисками |
| ДПК-5.1 | способностью применять модели и методы анализа и оценки рисков в экономических расчетах | Разделы 1-2 | Минимальный уровень | Знать: основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих деятельность предприятия железнодорожного транспорта, и оценки рисков в экономических расчетах |
| | | | | Уметь: осуществлять поиск информации по полученному заданию, сбор, анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач и оценки рисков в экономических расчетах |
| | | | | Владеть: основами построения на основе описания ситуаций стандартных теоретических и эконометрических моделей оценки рисков в экономических расчетах |
| | | | Базовый уровень | Знать: методы построения моделей, характеризующих деятельность предприятия железнодорожного транспорта, и оценки рисков в экономических расчетах |
| | | | | Уметь: осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей |

| | | | | | | | |
|---------|---|-------------|---------------------|---|--|-----------------|---|
| | | | | <p>Владеть: современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей, характеризующих экономические процессы предприятия железнодорожного транспорта, и оценки рисков в экономических расчетах</p> | | | |
| | | | Высокий уровень | <p>Знать: методы построения моделей объектов, процессов и явлений, их прогнозирования и оценки рисков в экономических расчетах</p> | | | |
| | | | | <p>Уметь: строить на основе описания ситуаций стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты, оценивать риски в экономических расчетах</p> | | | |
| | | | | <p>Владеть: современными методиками расчета и анализа социально-экономических показателей, характеризующих экономические процессы предприятия железнодорожного транспорта, и оценки рисков в экономических расчетах</p> | | | |
| ДПК-5.2 | способностью аргументировать выбор алгоритмов противодействия рискам в системе обеспечения экономической безопасности | Разделы 1-2 | Минимальный уровень | <p>Знать: понятие и принципы управления рисками</p> | | | |
| | | | | <p>Уметь: применять основы системного подхода к управлению рисками для обеспечения экономической безопасности</p> | | | |
| | | | | <p>Владеть: навыками описания организации как объекта управления, навыками практического применения законов и принципов организации</p> | | | |
| | | | | | | Базовый уровень | <p>Знать: понятие и принципы управления рисками, принципы проектирования систем управления рисками</p> |
| | | | | | | | <p>Уметь: проектировать алгоритм противодействия рискам в системе обеспечения экономической безопасности, систематизировать аналитические данные для построения алгоритмов управления рисками</p> |
| | | | | | | | <p>Владеть: навыками определения и классификации функций конкретной организации, их распределения между ее отдельными структурными подразделениями</p> |
| | | | | | | Высокий уровень | <p>Знать: понятие и принципы управления рисками, принципы проектирования систем управления рисками, подходы к стандартизации систем риск-менеджмента</p> |
| | | | | | | | <p>Уметь: проектировать алгоритма противодействия рискам и организовывать процесс принятия решений в системе обеспечения экономической безопасности</p> |
| | | | | | | | <p>Владеть: навыками выявления организационных патологий и разработки мер по их предупреждению; способностью управлять организационными изменениями, противодействовать рискам и организовывать процесс принятия решений в системе обеспечения экономической безопасности</p> |

**Программа контрольно-оценочных мероприятий
за период изучения дисциплины
(заочная форма)**

| № | Курс | Наименование контрольно-оценочного мероприятия | Объект контроля (понятия, тема / раздел дисциплины, компетенция, и т.д.) | Наименование оценочного средства (форма проведения) |
|---------------|------|--|---|---|
| 5 курс | | | | |
| 1 | 5 | Текущий контроль | 1.1 Понятие и особенности управления рисками | ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2 Конспект (письменно), собеседование (устно) |
| 2 | 5 | Текущий контроль | 1.2 Системы управления рисками | ПК-4, ДПК-5.1, Конспект (письменно), собеседование (устно) |

| | | | | | |
|----|---|--|---|------------------------------|---|
| | | | | ДПК-5.2 | |
| 3 | 5 | Текущий контроль | 1.3 Информация в системе управления рисками | ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2 | Конспект (письменно), собеседование (устно) |
| 4 | 5 | Текущий контроль | 1.4 Система управления проектными рисками | ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2 | Конспект (письменно), собеседование (устно) |
| 5 | 5 | Текущий контроль | 2.1 Моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками | ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2 | Конспект (письменно), собеседование (устно) |
| 6 | 5 | Текущий контроль | 2.2 Особенности финансовых рисков предприятия. Модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности. Модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия | ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2 | Конспект (письменно), собеседование (устно) |
| 7 | 5 | Текущий контроль | 2.3 Организация управления рисками. Подходы к стандартизации систем риск-менеджмента. Регламенты управления рисками | ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2 | Конспект (письменно), собеседование (устно) |
| 8 | 5 | Текущий контроль | 2.4 Оценка состояния защищенности объекта транспортной инфраструктуры и транспортных средств и соответствия реализуемых мер угрозам совершения актов незаконного вмешательства Разделы 1-2 | ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2 | Конспект (письменно), собеседование (устно) Тестирование по дисциплине (компьютерные технологии) |
| 9 | 5 | Промежуточный контроль - курсовая работа | Разделы 1-2 | ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2 | Темы курсовых работ, собеседование при защите (устно) |
| 10 | 5 | Промежуточная аттестация – экзамен | Разделы 1-2 | ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2 | Собеседование по экзаменационному билету (устно) |

2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Контроль качества освоения дисциплины включает в себя текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию. Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация обучающихся проводятся в целях установления соответствия достижений обучающихся поэтапным требованиям образовательной программы к результатам обучения и формирования компетенций.

Текущий контроль успеваемости – основной вид систематической проверки знаний, умений, навыков обучающихся. Задача текущего контроля – оперативное и регулярное управление учебной деятельностью обучающихся на основе обратной связи и корректировки. Результаты оценивания заносятся преподавателем в журнал и учитываются в виде средней оценки при проведении промежуточной аттестации

Для оценивания результатов обучения используется четырехбалльная шкала: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно» и двухбалльная шкала: «зачтено», «не зачтено».

Перечень оценочных средств сформированности компетенций представлен в нижеследующей таблице

| № | Наименование оценочного средства | Краткая характеристика оценочного средства | Представление оценочного средства в ФОС |
|--------------------------------------|----------------------------------|--|--|
| Текущий контроль успеваемости | | | |
| 1 | Тест | Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся | Типовые тестовые задания |
| 2 | Конспект лекции | Средство, позволяющее формировать и оценивать способность обучающегося к восприятию, обобщению и анализу информации. Может быть использовано для оценки знаний и умений обучающихся | Темы конспектов по темам |
| 3 | Собеседование | Средство контроля на практическом занятии, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Может быть использовано для оценки знаний обучающихся | Вопросы по темам |
| Промежуточный контроль | | | |
| 4 | Курсовая работа | Конечный продукт, получаемый в результате планирования и выполнения комплекса учебных и исследовательских заданий. Позволяет оценить умения обучающихся самостоятельно конструировать свои знания в процессе решения практических задач и проблем, ориентироваться в информационном пространстве и уровень сформированности аналитических, исследовательских навыков, навыков практического и творческого мышления. Выполняется обучающимися в индивидуальном порядке. Может быть использовано для оценки умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся в предметной или межпредметной областях | Темы курсовых работ, типовые вопросы к защите |
| 5 | Экзамен | Средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся | Вопросы к экзамену, типовые экзаменационные задачи |

Критерии и шкалы оценивания компетенций в результате изучения дисциплины при проведении *промежуточной аттестации* в форме курсовой работы и в форме экзамена (на 5 курсе для заочной формы), а также шкала для оценивания уровня освоения компетенций представлена в следующей таблице:

Критерии и шкала оценивания на экзамене

| Шкала оценивания | Критерии оценивания | Уровень освоения компетенций |
|-----------------------|---|------------------------------|
| «отлично» | Ответ логически структурирован, содержит полное раскрытие содержания теоретических вопросов, с рассмотрением различных точек зрения, встречающихся в экономической литературе, по ним (в случае если это предполагает содержание вопроса), высказыванием и обоснованием собственного мнения; решение задачи полностью верно и строго соответствует ее условию, результаты расчетов оформлены строго согласно предъявляемым требованиям, а в выводах содержится обобщение результатов анализа, количественное измерение выявленных потерь и экономическая интерпретация полученных результатов. Студент свободно владеет следующими компетенциями: ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2. | Высокий |
| «хорошо» | Ответ студента содержит недостаточно полное раскрытие теоретических вопросов (в т.ч. допускается отсутствие высказывания собственного мнения, выделения спорных моментов в обзоре вопроса); в решении задачи допущены погрешности в арифметических расчетах или формулировке экономических выводов, а также отдельные нарушения установленных правил оформления расчетов. Студент хорошо владеет следующими компетенциями: ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2. | Базовый |
| «удовлетворительно» | Ответ содержит поверхностное изложение сути поставленных вопросов, в расчетах допущены ошибки, в выводах отсутствует экономическая оценка полученных результатов анализа, однако в целом студент ориентируется по профилирующим вопросам дисциплины. Студент слабо владеет следующими компетенциями: ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2. | Минимальный |
| «неудовлетворительно» | Студент не может дать ответ на теоретическую часть билета (даже с учетом наводящих дополнительных вопросов), задача решена не верно, не содержит экономических выводов; кроме того, оценка «неудовлетворительно» ставится в том случае, если студент отказался отвечать на вопросы, поставленные в билете. Студент не владеет следующими компетенциями: ПК-4, ДПК-5.1, ДПК-5.2. | Компетенции не сформированы |

Критерии и шкала оценивания курсовой работы

| Шкала оценивания | Критерии оценивания |
|---------------------|---|
| «отлично» | Содержание курсовой работы полностью соответствует заданию, содержащемуся в методических указаниях, и плану. Представлены результаты структурированного и логически последовательного обзора литературных и иных источников по теме исследования. Структура курсовой работы логически и методически выдержана. Верно определены исходные данные для расчетов. Все аналитические расчеты выполнены верно, корректно применены методы финансового анализа, не нарушена методика анализа предмета исследования. Все выводы и предложения убедительно аргументированы. При защите курсовой работы обучающийся правильно и уверенно отвечает на вопросы преподавателя, демонстрирует глубокое знание теоретического материала, способен аргументировать собственные утверждения и выводы |
| «хорошо» | Содержание курсовой работы полностью соответствует заданию, содержащемуся в методических указаниях, и плану. Представлены результаты структурированного и логически последовательного обзора литературных и иных источников по теме исследования. Структура курсовой работы логически и методически выдержана. Верно определены исходные данные для расчетов. В расчетах допускаются незначительные (не искажающие общего итога оценки) погрешности/ошибки. Большинство выводов и предложений аргументировано, корректно применены методы финансового анализа, не нарушена методика анализа предмета исследования. Оформление курсовой работы и полученные результаты в целом отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. Имеются одна-две несущественные ошибки в использовании терминов, в построенных диаграммах и схемах, в оформлении таблиц. Наличествует незначительное количество грамматических и/или стилистических ошибок. При защите курсовой работы обучающийся правильно и уверенно отвечает на большинство вопросов преподавателя, демонстрирует хорошее знание теоретического материала, но не всегда способен аргументировать собственные утверждения и выводы. При наводящих вопросах преподавателя исправляет ошибки в ответе |
| «удовлетворительно» | Содержание курсовой работы полностью соответствует заданию, содержащемуся в методических указаниях, и плану. Результаты обзора литературных и иных источников представлены недостаточно полно, недостаточно логично и последовательно. Верно определены исходные данные для расчетов, но имеются грубые ошибки в расчетах. Аргументация выводов и предложений слабая или отсутствует. Экономические выводы носят констатирующий (описательный) характер. Имеются одно-два существенных отклонений от требований в оформлении курсовой работы. Полученные результаты в целом отвечают требованиям, |

| | |
|-----------------------|---|
| | изложенным в методических указаниях. Имеются одна-две существенных ошибки в использовании терминов, в построенных диаграммах и схемах. Много грамматических и/или стилистических ошибок. При защите курсовой работы обучающийся допускает грубые ошибки при ответах на вопросы преподавателя и /или не дал ответ более чем на 30% вопросов, демонстрирует слабое знание теоретического материала, в большинстве случаев не способен уверенно аргументировать собственные утверждения и выводы |
| «неудовлетворительно» | Содержание курсовой работы не соответствует заданию, содержащемуся в методических указаниях, и плану. Неверно определены исходные данные для расчетов, неверно и не корректно применены методы финансового анализа. Экономические выводы содержат неверную экономическую оценку. Имеются более двух существенных отклонений от требований в оформлении курсовой работы. Большое количество существенных ошибок по сути работы, много грамматических и стилистических ошибок и др. Полученные результаты не отвечают требованиям, изложенным в методических указаниях. При защите курсовой работы обучающийся демонстрирует слабое понимание программного материала, студент не может защитить свои решения, допускает грубые фактические ошибки при ответах на поставленные вопросы или вовсе не отвечает на них. Курсовая работа не представлена преподавателю. Обучающийся не явился на защиту курсовой работы |

Критерии и шкалы оценивания результатов обучения при проведении *текущего контроля* успеваемости.

Критерии и шкала оценивания конспекта лекций

| Шкала оценивания | Критерии оценивания |
|-----------------------|--|
| «отлично» | Конспект полный. В конспектируемом материале выделена главная и второстепенная информация. Установлена логическая связь между элементами конспектируемого материала. Даны определения основных понятий; основные формулы приведены с выводом, дана геометрическая иллюстрация. Приведены примеры |
| «хорошо» | Конспект полный. В конспектируемом материале выделена главная и второстепенная информация. Установлена не в полном объеме логическая связь между элементами конспектируемого материала. Даны определения основных понятий; основные формулы приведены без вывода, частично дана геометрическая иллюстрация. Примеры приведены частично |
| «удовлетворительно» | Конспект не полный. В конспектируемом материале не выделена главная и второстепенная информация. Не установлена логическая связь между элементами конспектируемого материала. Даны определения основных понятий; основные формулы приведены без вывода, нет геометрической иллюстрации. Примеры отсутствуют |
| «неудовлетворительно» | Конспект не удовлетворяет ни одному из критериев, приведенных выше |

Критерии и шкала оценивания при собеседовании

| Шкала оценивания | Критерии оценивания |
|-----------------------|--|
| «отлично» | Глубокое и прочное усвоение программного материала. Полные, последовательные, грамотные и логически излагаемые ответы при видоизменении задания. Обучающийся свободно справляется с поставленными задачами, может обосновать принятые решения, демонстрирует владение разносторонними навыками и приемами выполнения практических работ |
| «хорошо» | Знание программного материала, грамотное изложение, без существенных неточностей в ответе на вопрос, правильное применение теоретических знаний, владение необходимыми навыками при выполнении практических задач |
| «удовлетворительно» | Обучающийся демонстрирует усвоение основного материала, при ответе допускаются неточности, при ответе недостаточно правильные формулировки, нарушение последовательности в изложении программного материала, затруднения в выполнении практических заданий Слабое знание программного материала, при ответе возникают ошибки, затруднения при выполнении практических работ |
| «неудовлетворительно» | Не было попытки выполнить задание; отказ в ответе на поставленный вопрос |

Критерии и шкала оценивания тестирования при текущем контроле

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

3 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

3.1 Перечень вопросов при собеседовании (устном опросе)

Предел длительности контроля – 15 минут.

Тип опроса - фронтальный

Предлагаемое количество вопросов одному отвечающему – 1

| <i>№ темы</i> | <i>Вопросы</i> |
|---------------|---|
| Тема 1.1 | <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие и особенности управления рисками 2. Сущность управления рисками. 3. Особенности и отличие от другие видов управления. 4. Характеристики принятия решений при управлении рисками |
| Тема 1.2 | <ol style="list-style-type: none"> 1. Системы управления рисками Понятие системы управления. 2. Субъект и объект управления. 3. Принцип обратной связи. 4. Синтез системы управления рисками. 5. Сопряжение с системой управления хозяйствующего субъекта. 6. Риск как объект управления. 7. Сущность и особенности предпринимательских рисков. 8. Отношение предпринимателей к риску. 9. Предпринимательский риск, управление им и прибыль в долгосрочном периоде. 10. Особенности управления предпринимательскими рисками. 11. Построение системы риск-менеджмента в предпринимательстве |
| Тема 1.3 | <ol style="list-style-type: none"> 1. Информация в системе управления рисками Информация как мера снятия неопределенности. 2. Система сбора и обработки информации в системе управления рисками. 3. Управление рисками как информационный процесс |
| Тема 1.4 | <ol style="list-style-type: none"> 1. Система управления проектными рисками Необходимость и задача управления проектными рисками. 2. Особенности проектного управления и реализации проектных рисков. 3. Сценарное прогнозирование параметров бизнес-плана с учетом факторов риска. 4. Включение элементов риск-менеджмента в бизнес-план. |
| Тема 2.1 | <ol style="list-style-type: none"> 1. Моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками 2. Кибернетический и процессный подходы к построению и анализу системы управления рисками. 3. Подходы к моделированию бизнес-процессов. 4. Анализ и построение регламентов бизнес-процессов и организационной структуры для целей управления рисками. 5. Составление регламентов и процедур управления рисками. |
| Тема 2.2 | <ol style="list-style-type: none"> 1. Особенности финансовых рисков предприятия. 2. Модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности. 3. Модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия 4. Понятие и особенности проявления финансовых рисков предприятия. 5. Показатели, используемые для оценки рисков. 6. Модель оценки финансовых рисков предприятия: продольный и поперечный анализ. 7. Основные предпосылки оценки риска финансовой несостоятельности. 8. Моделирование риска финансовой несостоятельности хозяйствующего субъекта |
| Тема 2.3 | <ol style="list-style-type: none"> 1. Организация управления рисками. Подходы к стандартизации систем риск-менеджмента. Регламенты управления рисками 2. Необходимость и сложности разработки и внедрения стандартов риск-менеджмента. Международные стандарты ERM, PMBOK, ISO. Их особенности, проблемы применения российскими предприятиями 3. Характеристики принятия решений при управлении рисками. 4. Система отечественных стандартов управления рисками |
| Тема 2.4 | <ol style="list-style-type: none"> 1. Оценка состояния защищенности объекта транспортной инфраструктуры и транспортных средств и соответствия реализуемых мер угрозам совершения актов незаконного вмешательства. Функции системы мер по обеспечению транспортной безопасности 2. Категорирование ОТИ и (или) ТС, оценка уязвимости ОТИ и (или) ТС 3. Порядок разработки планов обеспечения транспортной безопасности ОТИ и (или) ТС 4. Силы обеспечения транспортной безопасности. Подразделения транспортной безопасности 5. Ограничения при выполнении работ, непосредственно связанных с обеспечением транспортной безопасности |

| | |
|--|--|
| | <p>6. Планирование мер по обеспечению транспортной безопасности ОТИ и (или) ТС, секторы зоны транспортной безопасности и критические элементы, методы и технические средства обеспечения транспортной безопасности, разработка, принятие и исполнение внутренних организационно-распорядительных документов</p> <p>7. Планирование мер по обеспечению транспортной безопасности ОТИ и (или) ТС – управление инженерно-техническими системами, техническими средствами и силами ОТБ</p> <p>8. Ресурсное обеспечение транспортной безопасности</p> |
|--|--|

3.2. Темы конспектов

| № темы | План / содержание конспекта по теме, рекомендуемая литература |
|--------|---|
| 1.1 | Понятие и особенности управления рисками. Сущность управления рисками. Особенности и отличие от другие видов управления. Характеристики принятия решений при управлении рисками |
| 1.2 | Системы управления рисками Понятие системы управления. Субъект и объект управления. Принцип обратной связи. Синтез системы управления рисками. Сопряжение с системой управления хозяйствующего субъекта. Риск как объект управления. Сущность и особенности предпринимательских рисков. Отношение предпринимателей к риску. Предпринимательский риск, управление им и прибыль в долгосрочном периоде. Особенности управления предпринимательскими рисками. Построение системы риск-менеджмента в предпринимательстве |
| 1.3 | Информация в системе управления рисками Информация как мера снятия неопределенности. Система сбора и обработки информации в системе управления рисками. Управление рисками как информационный процесс |
| 1.4 | Система управления проектными рисками Необходимость и задача управления проектными рисками. Особенности проектного управления и реализации проектных рисков. Сценарное прогнозирование параметров бизнес-плана с учетом факторов риска. Включение элементов риск-менеджмента в бизнес-план. |
| 2.1 | Моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками Кибернетический и процессный подходы к построению и анализу системы управления рисками. Подходы к моделированию бизнес-процессов. Анализ и построение регламентов бизнес-процессов и организационной структуры для целей управления рисками. Составление регламентов и процедур управления рисками. |
| 2.2 | Особенности финансовых рисков предприятия. Модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности. Модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия Понятие и особенности проявления финансовых рисков предприятия. Показатели, используемые для оценки рисков. Модель оценки финансовых рисков предприятия: продольный и поперечный анализ. Основные предпосылки оценки риска финансовой несостоятельности. Моделирование риска финансовой несостоятельности хозяйствующего субъекта |
| 2.3 | Организация управления рисками. Подходы к стандартизации систем риск-менеджмента. Регламенты управления рисками Необходимость и сложности разработки и внедрения стандартов риск-менеджмента. Международные стандарты ERM, PMBOK, ISO. Их особенности, проблемы применения российскими предприятиями Характеристики принятия решений при управлении рисками. Система отечественных стандартов управления рисками |
| 2.4 | Оценка состояния защищенности объекта транспортной инфраструктуры и транспортных средств и соответствия реализуемых мер угрозам совершения актов незаконного вмешательства. Функции системы мер по обеспечению транспортной безопасности. Категорирование ОТИ и (или) ТС, оценка уязвимости ОТИ и (или) ТС Порядок разработки планов обеспечения транспортной безопасности ОТИ и (или) ТС Силы обеспечения транспортной безопасности. Подразделения транспортной безопасности Ограничения при выполнении работ, непосредственно связанных с обеспечением транспортной безопасности Планирование мер по обеспечению транспортной безопасности ОТИ и (или) ТС, секторы зоны транспортной безопасности и критические элементы, методы и технические средства обеспечения транспортной безопасности, разработка, принятие и исполнение внутренних организационно-распорядительных документов Планирование мер по обеспечению транспортной безопасности ОТИ и (или) ТС – управление инженерно-техническими системами, техническими средствами и силами ОТБ Ресурсное обеспечение транспортной безопасности |

3.3 Перечень вопросов к экзамену

| № темы | Вопросы |
|----------|---|
| Тема 1.1 | <ol style="list-style-type: none"> 1. Понятие и особенности управления рисками 2. Сущность управления рисками. 3. Особенности и отличие от другие видов управления. 4. Характеристики принятия решений при управлении рисками |
| Тема 1.2 | <ol style="list-style-type: none"> 5. Системы управления рисками Понятие системы управления. |

| | |
|----------|---|
| | <ul style="list-style-type: none"> 6. Субъект и объект управления. 7. Принцип обратной связи. 8. Синтез системы управления рисками. 9. Сопряжение с системой управления хозяйствующего субъекта. 10. Риск как объект управления. 11. Сущность и особенности предпринимательских рисков. 12. Отношение предпринимателей к риску. 13. Предпринимательский риск, управление им и прибыль в долгосрочном периоде. 14. Особенности управления предпринимательскими рисками. 15. Построение системы риск-менеджмента в предпринимательстве |
| Тема 1.3 | <ul style="list-style-type: none"> 16. Информация в системе управления рисками Информация как мера снятия неопределенности. 17. Система сбора и обработки информации в системе управления рисками. 18. Управление рисками как информационный процесс |
| Тема 1.4 | <ul style="list-style-type: none"> 19. Система управления проектными рисками. Необходимость и задача управления проектными рисками. 20. Особенности проектного управления и реализации проектных рисков. 21. Сценарное прогнозирование параметров бизнес-плана с учетом факторов риска. 22. Включение элементов риск-менеджмента в бизнес-план. |
| Тема 2.1 | <ul style="list-style-type: none"> 23. Моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками 24. Кибернетический и процессный подходы к построению и анализу системы управления рисками. 25. Подходы к моделированию бизнес-процессов. 26. Анализ и построение регламентов бизнес-процессов и организационной структуры для целей управления рисками. 27. Составление регламентов и процедур управления рисками. |
| Тема 2.2 | <ul style="list-style-type: none"> 28. Особенности финансовых рисков предприятия. 29. Модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности. 30. Модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия 31. Понятие и особенности проявления финансовых рисков предприятия. 32. Показатели, используемые для оценки рисков. 33. Модель оценки финансовых рисков предприятия: продольный и поперечный анализ. 34. Основные предпосылки оценки риска финансовой несостоятельности. 35. Моделирование риска финансовой несостоятельности хозяйствующего субъекта |
| Тема 2.3 | <ul style="list-style-type: none"> 36. Организация управления рисками. Подходы к стандартизации систем риск-менеджмента. Регламенты управления рисками 37. Необходимость и сложности разработки и внедрения стандартов риск-менеджмента. Международные стандарты ERM, PMBOK, ISO. Их особенности, проблемы применения российскими предприятиями 38. Характеристики принятия решений при управлении рисками. 39. Система отечественных стандартов управления рисками |
| Тема 2.4 | <ul style="list-style-type: none"> 40. Оценка состояния защищенности объекта транспортной инфраструктуры и транспортных средств и соответствия реализуемых мер угрозам совершения актов незаконного вмешательства. Функции системы мер по обеспечению транспортной безопасности 41. Категорирование ОТИ и (или) ТС, оценка уязвимости ОТИ и (или) ТС 42. Порядок разработки планов обеспечения транспортной безопасности ОТИ и (или) ТС 43. Силы обеспечения транспортной безопасности. Подразделения транспортной безопасности 44. Ограничения при выполнении работ, непосредственно связанных с обеспечением транспортной безопасности 45. Планирование мер по обеспечению транспортной безопасности ОТИ и (или) ТС, секторы зоны транспортной безопасности и критические элементы, методы и технические средства обеспечения транспортной безопасности, разработка, принятие и исполнение внутренних организационно-распорядительных документов 46. Планирование мер по обеспечению транспортной безопасности ОТИ и (или) ТС – управление инженерно-техническими системами, техническими средствами и силами ОТБ 47. Ресурсное обеспечение транспортной безопасности |

3.4 Типовые экзаменационные задачи

Задача 1. Имеются два варианта вложения капитала. Установлено, что при вложении капитала в мероприятие А получение прибыли в сумме 15 млн р. имеет вероятность 0,6, а в мероприятие В получение прибыли в сумме 20 млн р. – вероятность 0,4. Определите ожидаемое получение прибыли от вложения капитала (математическое ожидание) и рассмотрите вероятность наступления события объективным и субъективным методами.

Задача 2. Оцените варианты финансовых вложений инвестора, с целью минимизации риска, используя методику вероятного распределения доходности. Имеется два альтернативных варианта финансовых вложений с характеристиками, представленными в таблице.

Таблица. Характеристики финансовых инструментов

| Показатели | Варианты вложений | | Вероятность осуществления, % |
|---|-------------------|----|------------------------------|
| | А | Б | |
| 1. Рыночная цена ценной бумаги, тыс. р. | 14 | 19 | |
| 2. Экспертная оценка доходности: | | | |
| 2.1. пессимистическая | 9 | 7 | 25 |
| 2.2. наиболее вероятная | 11 | 12 | 60 |
| 2.3. оптимистическая | 14 | 15 | 15 |

Задача 3. Выберите наименее рискованный вариант вложения капитала путем сравнения значений коэффициентов вариации.

Первый вариант. Прибыль при средней величине 30 млн р. колеблется от 15 до 40 млн р. Вероятность получения прибыли в 15 млн р. равна 0,2 и прибыли в 40 млн р. – 0,3.

Второй вариант. Прибыль при средней величине 25 млн р. колеблется от 20 до 30 млн р. Вероятность получения прибыли в 20 млн р. равна 0,4 и прибыли в 30 млн р. – 0,3.

Задача 4. Определите среднюю ожидаемую прибыль, ожидаемую стоимость информации при условиях определенности и неопределенности, а также стоимость полной информации.

Если предприниматель стоит перед выбором, сколько ему закупить товара: 100 или 200 единиц. При закупке 100 единиц товара затраты составят 120 тыс. р. за единицу, а при закупке 200 единиц – 100 тыс. р. за единицу. Предприниматель данный товар будет продавать по 180 тыс. р. за единицу. Однако он не знает, будет ли спрос на него. Весь не проданный в срок товар может быть реализован только по цене 90 тыс. р. и менее. При продаже товара вероятность составляет «50 на 50», т.е. существует вероятность 0,5 для продажи 100 единиц товара и 0,5 для продажи 200 единиц товара.

Задача 5. Хозяйствующий субъект решил заключить трехмесячный срочный форвардный контракт на покупку 10 тыс. долл. США по форвардному курсу 27,20 р. за 1 долл. Следовательно, затраты на покупку валюты по контракту составили 272 тыс. р.

Рассмотрите процесс хеджирования с помощью форвардной операции и определите:

а) экономию денежных ресурсов или потенциальную прибыль, если через три месяца на день исполнения контракта курс спот составит до 27,80 р. за долл.;

б) упущенную выгоду или потенциальные потери, если через три месяца на день исполнения контракта курс спот снизится до 26,80 р. за долл.

Задача 6. Хозяйствующий субъект планирует осуществить через три месяца платежи в сумме 10 тыс. долл. США. При этом он отказался от хеджирования валютных рисков. В данный момент курс спот составляет 25,00 р. за 1 долл. Следовательно, затраты на покупку 10 тыс. долл. составят 250 тыс. р.

Рассмотрите, в чем проявляется преимущество, а в чем недостаток отказа от хеджирования. Определите потенциальную прибыль (экономия денежных средств) и дополнительные затраты на покупку валюты. Если через три месяца курс доллара понизится до 24,80 р. за 1 долл. Если через три месяца курс спот возрастет до 25,80 р. за 1 долл.

Задача 7. Предприятие-заемщик заключило договор страхования риска непогашения кредита со страховой компанией. Кредит взят в сумме 120 млн р. под 40% годовых с 1.01.2014 по 31.12.2014 г. Погашение кредита и процентов по нему согласно кредитного договора должно осуществляться раз в полугодие. Заемщик оказался не в состоянии вернуть последний платеж и проценты по нему. Предел ответственности 70%. Страховой тариф 5,2%.

Определите страховую сумму, сумму страховых платежей и потерь по кредитному риску (сумму страхового возмещения в результате наступления страхового случая).

Задача 8. Банк заключил договор страхования риска непогашения кредита со страховой компанией. Банк-страхователь выдал кредит на 80 млн р. под 46% годовых. Предел ответственности 70%. Страховой тариф 6,8%. Заемщик оказался не в состоянии выплатить проценты за кредит. Кредитный договор заключен на срок с 1 января 2014 по 31 июня 2014 года.

Определите страховую сумму, сумму страховых платежей и потерь по кредитному риску (сумму страхового возмещения).

Задача 9. Определите сумму потерь (ущерба) на 1 га и на всю площадь посева.

Если в результате стихийного бедствия часть поля в 12 га пришлось пересевать. Затраты на 1 га составили — 33 тыс. р. Стоимость застрахованного урожая с 1 га определена в 800 тыс. р. Валовой сбор после страхового случая составил 1200 тонн. Цена 1 тонны — 26 тыс. р. Общая площадь посева — 50 га.

Задача 10. Владелец груза стоимостью 500 млн р. застраховал его в страховой компании. Владелец предпочел вариант страхования без ответственности за повреждение. Процент страхового возмещения определен в 70%. В результате стихийного бедствия часть груза погибла (100 млн р.). Часть груза повреждена (25 млн р.). Страховой тариф 5%.

Определите страховую сумму, сумму страховых платежей и сумму потерь (сумму страхового возмещения) в результате наступления страхового случая.

3.5 Тематика курсовых работ

Курсовая работа выполняется каждым обучающимся индивидуально (в 8 семестре – для очной формы) *на материалах конкретного транспортного предприятия (того, которое является базой для прохождения практики и последующего выполнения ВКР)* по одной из следующих тем (выбор темы зависит от состава форм отчетности, организационно-правового статуса предприятия, формы собственности и внутриотраслевой принадлежности предприятия):

- 1 Построение корпоративной системы управления рисками хозяйствующего субъекта
- 2 Разработка проекта/ проектирование стратегии/ управления рисками промышленного предприятия
- 3 Разработка проекта управления рисками проекта/промышленного предприятия на основе показателей толерантности к риску
- 4 Разработка системы мониторинга рисков проекта/программы
- 5 Разработка системы управления рисками портфеля проектов для предприятия
- 6 Разработка проекта стратегического управления рисками в компании
- 7 Разработка системы риск-менеджмента в управлении развитием бизнеса
- 8 Разработка системы управления рисками на основе рисковой стоимости (VAR)
- 9 Проектирование системы управления рисками на различных стадиях жизненного цикла организации
- 10 Разработка системы управления рисками организации на основе процессного подхода
- 11 Проектирование системы риск-менеджмента на предприятии
- 12 Разработка проекта бизнес-плана с включением элементов риск-менеджмента
- 13 Разработка системы управления рисками организации с использованием стандартов риск-менеджмента
- 14 Разработка проекта включения системы управления рисками в систему управления хозяйствующего субъекта
- 15 Разработка проекта управления бизнес-процессами организации с включением элементов риск-менеджмента
- 16 Разработка проекта построения регламентов бизнес-процессов для целей управления рисками
- 17 Разработка проекта управления финансовыми рисками предприятия / организации
- 18 Разработка проекта управления предпринимательскими рисками хозяйствующего субъекта
- 19 Разработка проекта диагностики и управления рисками предприятия / организации
- 20 Разработка системы мониторинга рисков на предприятии

- 21 Разработка проекта управления рисками в инвестиционной деятельности предприятия
- 22 Разработка проекта управления рисками организации с использованием международных стандартов риск-менеджмента (ERM, PMBOK, ISO)
- 23 Проектирование системы управления рисками закупочной подсистемы организации
- 24 Проектирование управления рисками трансформационных программ предприятия
- 25 Проектирование системы управления рисками в комплексных проектах
- 26 Разработка системы управления рисками проектов, реализуемых с использованием проектного финансирования
- 27 Проектирование системы диагностики и управления рисками предприятия / организации
- 28 Проектирование системы управления рисками предприятия/организации в условиях кризиса
- 29 Проектирование функциональной системы управления рисками предприятия / организации
- 30 Проектирование системы управления рисками организации на основе принципов адаптивного риск-менеджмента
- 31 Разработка стратегии управления рисками как составная часть плана развития организации

Типовые планы курсовых работ содержатся в Методических указаниях по выполнению курсовых работ по дисциплине «Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов».

Типовые вопросы при защите курсовой работы:

1. Раскройте понятие системы управления проектными рисками.
2. Каковы особенности проектного управления и реализации проектных рисков.
3. Что включает сценарное прогнозирование параметров бизнес-плана с учетом факторов риска.
4. Как проводится включение элементов риск-менеджмента в бизнес-план
5. Раскройте методологические подходы к моделированию бизнес-процессов в системе управления рисками
6. Как проводится анализ и построение регламентов бизнес-процессов и организационной структуры для целей управления рисками
7. В чем заключается моделирование риска финансовой несостоятельности хозяйствующего субъекта.

3.6 Типовые тестовые задания по дисциплине

Тестирование проводится по окончании и в течение года по завершении изучения дисциплины (контроль/проверка остаточных знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности). Компьютерное тестирование обучающихся по дисциплине используется при проведении текущего контроля знаний обучающихся. Результаты тестирования могут быть использованы при проведении промежуточной аттестации (зачет в конце 7-го семестра).

Тесты формируются из фонда тестовых заданий по дисциплине.

Тест (педагогический тест) – это система заданий – тестовых заданий возрастающей трудности, специфической формы, позволяющая эффективно измерить уровень знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся.

Тестовое задание (ТЗ) – варьирующаяся по элементам содержания и по трудности единица контрольного материала, минимальная составляющая единица сложного (составного) педагогического теста, по которой испытуемый в ходе выполнения теста совершает отдельное действие.

Фонд тестовых заданий (ФТЗ) по дисциплине – это совокупность систематизированных диагностических заданий – тестовых заданий (ТЗ), разработанных по всем тематическим разделам (дидактическим единицам) дисциплины (прошедших апробацию, экспертизу, регистрацию и имеющих известные характеристики) специфической формы, позволяющей автоматизировать процедуру контроля.

Типы тестовых заданий:

ЗТЗ – тестовое задание закрытой формы (ТЗ с выбором одного или нескольких правильных ответов);

ОТЗ – тестовое задание открытой формы (с конструируемым ответом: ТЗ с кратким регламентируемым ответом (ТЗ дополнения); ТЗ свободного изложения (с развернутым ответом в произвольной форме)).

**Структура тестовых материалов по дисциплине
«Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов»**

| Компетенция | Тема в соответствии с РПД (с соответствующим номером) | Содержательный элемент | Характеристика содержательного элемента | Количество тестовых заданий, типы ТЗ |
|--|---|---|---|---|
| 5 курс | | | | |
| <p>ПК-4: способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;</p> <p>ДПК-5.1: способностью применять модели и методы анализа и оценки рисков в экономических расчетах;</p> <p>ДПК-5.2: способностью аргументировать выбор алгоритмов противодействия рискам в системе обеспечения экономической безопасности</p> | 1.1 Понятие и особенности управления рисками | Понятие риска и его проявления | Знание | 6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ |
| | | Источники возникновения рисков | Умение | 6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ |
| | | Принципы управления рисками хозяйствующих субъектов | Действие | 6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ |
| | 1.2 Системы управления рисками | Классификация рисков хозяйствующих субъектов | Знание | 6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ |
| | | Построение системы управления рисками | Умение | 6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ |
| | | Процесс управления рисками | Действие | 6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ |
| | 1.3 Информация в системе управления рисками | Виды информации в системе управления рисками | Знание | 6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ |
| | | Источники сбора информации | Умение | 6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ |
| | | Методы сбора информации в системе управления рисками | Действие | 8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ |
| | 1.4 Система управления проектными рисками | Риски проектов хозяйствующих субъектов | Знание | 8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ |
| | | Принципы проектного управления | Умение | 8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ |
| | | Подходы к управлению проектными рисками | Действие | 8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ |
| | 2.1 Моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками | Сущность процессного подхода в управлении деятельностью хозяйствующих субъектов | Знание | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | | Виды процессов в организации | Умение | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | | Моделирование бизнес-процессов в системе управления рисками статистики | Действие | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | 2.2 Особенности финансовых рисков предприятия. Модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности. Модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия | Особенности финансовых рисков предприятия | Знание | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | | Модели оценки финансовых рисков на основе бухгалтерской отчетности | Умение | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | | Модель оценки риска финансовой несостоятельности предприятия | Действие | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | 2.3 Организация управления рисками. Подходы к стандартизации систем риск-менеджмента. Регламенты управления рисками | Организация управления рисками | Знание | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | | Виды группировки | Умение | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | | Ряды распределения | Действие | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | 2.4 Оценка состояния защищенности объекта транспортной инфраструктуры и транспортных средств и соответствия реализуемых мер угрозам совершения актов незаконного вмешательства | Принципы построения обобщающих показателей | Знание | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |
| | | Обобщающие статистические показатели в анализе социально-экономических явлений | Умение | 10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ |

| | | | | |
|---------------------|--|--|----------|--------------------------------------|
| | | Обобщающие статистические показатели в прогнозировании социально-экономических явлений | Действие | 10 – ОТЗ 10– ЗТЗ |
| Итого по дисциплине | | | | 200 – ОТЗ 200 – ЗТЗ |

Полный комплект ФТЗ хранится в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС и обучающийся имеет возможность ознакомиться с демонстрационным вариантом ФТЗ.

Ниже приведен образец типового варианта итогового теста, предусмотренного рабочей программой дисциплины

*Образец типового варианта итогового теста,
предусмотренного рабочей программой дисциплины*

Количество – 9 ОТЗ и 9 ЗТЗ.

Норма времени – 45 мин.

1. Для негативного риска вероятность наступления в 50% по стандартам FERMA считается:
 - а) высокой
 - б) может быть любой в зависимости от выбранной шкалы
 - в) средней
 - г) низкой

2. Какие дополнительные аспекты бизнеса рассматривает STEEPLED-анализ по сравнению с PESTLE-анализом?
 - а) Образовательные и демографические
 - б) Демографические и риски экспорта
 - в) Образовательные и риски неопределенности
 - г) Ни один ответ не верен

3. Каким образом можно организовать исполнение функции риск-менеджмента в соответствии со стандартами FERMA в организации?
 - а) Сформировать отдельное структурное подразделение
 - б) Все ответы верны
 - в) Выделить или набрать специалистов по управлению рисками
 - г) Пригласить внештатного консультанта

4. Какова ключевая особенность современного подхода к управлению рисками?
 - а) Наличие наработок, позволяющих определить возможные риски для каждой из отраслей
 - б) Использование самых современных и точных математических методов
 - в) Рассмотрение как позитивных, так и негативных рисков
 - г) Все ответы верны

5. Какой из методов анализа целесообразно применить для выявления стратегических рисков?
 - а) HAZOP
 - б) FTA
 - в) PESTLE
 - г) FMEA

6. Какой тип рисков невозможно рассчитать статистическими методами?
 - а) Стратегический
 - б) Операционный

- в) Риск прочих опасностей
- г) Финансовый

70. Что является преимуществом экспертных методов расчета рисков по сравнению со статистическими?

- а) Возможность расчета финансовых рисков
- б) Привлечение квалифицированных экспертов
- в) Возможность расчета рисков опасностей
- г) Возможность оценки любого риска

8 Функции субъекта управления в риск-менеджменте:

- а) прогнозирование, планирование, организация, регулирование, координация, стимулирование и контроль;
- б) прогнозирование, организация, регулирование, координация, мотивация, анализ и контроль;
- в) прогнозирование, организация, регулирование, координация, стимулирование и контроль)

9. Способы страхования риска невыполнения договорных обязательств:

- а) страхование коммерческих (товарных) кредитов и лизинговых операций;
- б) страхование товарных и других видов кредитов;
- в) страхование кредитов и лизинговых операций)

10 Дополните. Предельное значение величины допустимого риска при заключении сделок составляет _____

11 Дополните. Для оценки риска может использоваться метод Дельфи, который является разновидностью _____ метода

12 Дополните. Показатель, выражающий количество риска на единицу доходности и являющийся комплексным относительным показателем, который позволяет сравнивать результаты, выраженные в разных единицах измерения, - это _____

13 Дополните. Планируемые величины в ходе осуществления прогноза оцениваются понятием _____

14 Дополните. Правила обработки статистической информации о вероятностной среде предпринимательства с целью принятия эффективных рискованных решений представляют собой _____ правила принятия решений

15 Дополните. Ситуация, когда информация о рисковом событии существует в виде частоты (вероятности) его появления, называется ситуацией _____ неопределенности

16 Дополните. Первая точка кривой рисков определяет вероятность _____ потерь

17 Дополните. Критерий, направленный на минимизацию потерь от неверно принятого решения, называется критерием _____

18 Дополните. Корректирующий коэффициент α , используемый при выборе решения по критерию Гурвица, называется коэффициентом _____

4 Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

В таблице дано описание процедур проведения контрольно-оценочных мероприятий, соответствующих рабочей программе дисциплины, и процедур оценивания результатов обучения с помощью спланированных оценочных средств.

| Наименование оценочного средства | Описания процедуры проведения контрольно-оценочного мероприятия и процедуры оценивания результатов обучения |
|----------------------------------|--|
| Тест | Тестирование, предусмотренное рабочей программой дисциплины, проводится во время практических занятий. Тестирование проводится с использованием компьютерных технологий. Варианты тестовых заданий формируются случайно из базы ТЗ. Во время выполнения заданий пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий не разрешено |
| Конспект | Преподаватель не менее, чем за неделю до срока выполнения конспекта должен довести до сведения обучающихся тему конспекта и указать необходимую учебную литературу. Темы и перечень необходимой учебной литературы выложены в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет. Конспект должен быть выполнен в установленный преподавателем срок. Конспекты в назначенный срок сдаются на проверку |
| Собеседование | Собеседование проводится по темам дисциплины в соответствии с рабочей программой на практическом занятии. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения собеседования, доводит до обучающихся вопросы для собеседования по теме занятия и дает перечень литературных источников для подготовки к собеседованию. На занятии-собеседовании преподаватель может самостоятельно выбрать вопрос для собеседования с конкретным студентом или группой студентов из предложенного перечня. В ходе собеседования обучающийся должен показать степень владения темой, знания основных терминов, формул, умение пользоваться категориальным аппаратом и формулами, продемонстрировать навыки владения методами и средствами решения практических задач по теме. |
| Курсовая работа | Курсовая работа выполняется обучающимся самостоятельно и индивидуально по данным конкретного предприятия (предприятия, на материалах которого осуществляется реализация программы практик и последующее выполнение ВКР). Темы и типовые планы курсовых работ, а также рекомендации по ее выполнению, оформлению и подготовке к защите содержатся в специальных Методических указаниях, размещенных в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет. После проверки выполнения курсовой работы она подлежит защите в форме ответа на устные вопросы, задаваемые преподавателем. При оценке курсовой работы учитывается ее содержание, соблюдение срока выполнения, оформление и уровень ответа на поставленные вопросы. |
| Экзамен | Допуском к экзамену являются результаты тестирования. При проведении промежуточной аттестации в форме экзамена будут использованы результаты проведения экзамена в виде собеседования по экзаменационному билету (устно). Оценочные средства и типовые контрольные задания текущего контроля позволяют оценить знания, умения и владения навыками/опытом деятельности обучающихся при освоении дисциплины. |

Описание процедур проведения промежуточной аттестации в форме экзамена и оценивания результатов обучения

Промежуточная аттестация в форме экзамена проводится путем устного собеседования по билетам. Билеты составлены таким образом, что в каждый из них включал в себя теоретические вопросы и практическое задание.


Билет содержит: два теоретических вопроса для оценки знаний. Теоретические вопросы выбираются из перечня вопросов к экзамену; практическое задание: оценивают умения, навыки и (или) опыта деятельности.

Распределение теоретических вопросов и практических заданий по экзаменационным билетам находится в закрытом для обучающихся доступе. Разработанный комплект билетов (25-30 билетов) не выставляется в электронную информационно-образовательную среду КриЖТ ИрГУПС, а хранится на кафедре-разработчике ФОС на бумажном носителе в составе ФОС по дисциплине.

На экзамене обучающийся берет билет, для подготовки ответа на экзаменационный билет обучающемуся отводится время в пределах 45 минут. В процессе ответа обучающегося на вопросы и задания билета, преподаватель может задавать дополнительные вопросы.

Каждый вопрос/задание билета оценивается по пятибалльной системе, а далее вычисляется среднее арифметическое оценок, полученных за каждый вопрос/задание. Среднее арифметическое оценок округляется до целого по правилам округления.

Образец экзаменационного билета

| | | |
|---|--|---|
|  20...-20.. учебный год | Экзаменационный билет № 1 по дисциплине «Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов» 5 курс | Утверждаю: Заведующий кафедрой УП _____ |
|---|--|---|

1. Предпринимательский риск, управление им в долгосрочном периоде
2. Кибернетический и процессный подходы к построению и анализу системы управления рисками
3. **Задача.**

Выберите наименее рискованный вариант вложения капитала путем сравнения значений коэффициентов вариации.

Первый вариант. Прибыль при средней величине 30 млн р. колеблется от 15 до 40 млн р. Вероятность получения прибыли в 15 млн р. равна 0,2 и прибыли в 40 млн р. – 0,3.

Второй вариант. Прибыль при средней величине 25 млн р. колеблется от 20 до 30 млн р. Вероятность получения прибыли в 20 млн р. равна 0,4 и прибыли в 30 млн р. – 0,3.

Задания, по которым проводятся контрольно-оценочные мероприятия, оформляются в соответствии с положением о формировании фонда оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной и государственной итоговой аттестации, не выставляются в электронную информационно-образовательную среду КриЖТ ИрГУПС, а хранятся на кафедре-разработчике ФОС на бумажном носителе в составе ФОС по дисциплине.