

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 «31» мая 2024 г. № 425-1

**Б1.В.ДВ.08.01 Проектирование систем управления рисками
хозяйствующих субъектов**

рабочая программа дисциплины

Направление подготовки – 38.03.01 Экономика

Профиль – Экономическая безопасность, анализ и управление рисками

Квалификация выпускника – бакалавр

Форма и срок обучения – 4 года очная форма

Кафедра-разработчик программы – Управление персоналом

Общая трудоемкость в з.е. – 7

Формы промежуточной аттестации в семестрах

Часов по учебному плану (УП) – 252 очная форма обучения: зачет 7, экзамен 8, курсовая работа 8

В том числе в форме практической
подготовки (ПП) – 8

Очная форма обучения Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр	7	8	Итого
Число недель в семестре	14	12	
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП	Часов по УП
Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий	42/4	36/4	78/8
– лекции	14	12	26
– практические (семинарские)	28/4	24/4	52/8
Самостоятельная работа	66	72	138
Экзамен		36	36
Итого	108	144	252

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 федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утвержденным Приказом Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954.

Программу составил:
канд. экон. наук, доцент, доцент

А.А. Малахова

Рабочая программа рассмотрена и одобрена для использования в учебном процессе на заседании кафедры «Управление персоналом», протокол от «18» апреля 2024 г. № 10.

Заведующий кафедрой, канд. техн. наук, доцент

В.О. Колмаков

1 ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ	
1.1 Цели дисциплины	
1	формирование у обучающихся компетенций, необходимых для проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов с учетом особенностей деятельности и осуществляемых бизнес-процессов
1.2 Задачи дисциплины	
1	сформировать у обучающихся представление о применении системного подхода в управлении рисками – путем выявления элементов, подверженных рискам, и связей между этими элементами;
2	сформировать у обучающихся навыки в области сбора и анализа информации, необходимой для проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов;
3	сформировать у обучающихся навыки расчета и интерпретации экономических показателей в процессе проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов.
1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины	
Профессионально-трудовое воспитание обучающихся	
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.	
Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:	
– формирование сознательного отношения к выбранной профессии;	
– воспитание чести, гордости, любви к профессии, сознательного отношения к профессиональному долгу, понимаемому как личная ответственность и обязанность;	
– формирование психологии профессионала;	
– формирование профессиональной культуры, этики профессионального общения;	
– формирование социальной компетентности и другие задачи, связанные с имиджем профессии и авторитетом транспортной отрасли	
Научно-образовательное воспитание обучающихся	
Цель научно-образовательного воспитания – создание условий для реализации научно-образовательного потенциала обучающихся в форме наставничества, тьюторства, научного творчества.	
Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:	
– 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	

2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	
2.1 Требования к предварительной подготовке обучающегося	
1	Б1.В.ДВ.03.01 Теневая экономика и экономическая безопасность
2	Б1.В.ДВ.03.02 Теневая экономическая деятельность
3	Б1.В.ДВ.04.01 Национальная и региональная экономическая безопасность
4	Б1.В.ДВ.04.02 Обеспечение экономической безопасности государства
5	Б1.В.ДВ.05.01 Правовые основы обеспечения экономической безопасности и правовые риски
6	Б1.В.ДВ.05.02 Организация предупреждения правонарушений в экономической сфере
7	Б1.В.ДВ.06.01 Методология и практика обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов
8	Б1.В.ДВ.06.02 Система обеспечения экономической безопасности организации
9	Б1.В.ДВ.07.01 Обеспечение экономической безопасности в транспортной отрасли
10	Б1.В.ДВ.07.02 Теоретические основы экономической безопасности
2.2 Дисциплины и практики, для которых изучение данной дисциплины необходимо как предшествующее	
1	Б1.В.ДВ.08.02 Организация систем обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов

2	Б1.В.ДВ.09.01 Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности
3	Б1.В.ДВ.09.02 Управление рисками операций на финансовом рынке
4	Б1.В.ДВ.15.01 Управление рисками инвестиционной деятельности
5	Б1.В.ДВ.15.02 Инвестиционные риски организации
6	Б2.О.04(Пд) Производственная - преддипломная практика
7	Б3.02(Д)Защита выпускной квалификационной работы

3 ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ТРЕБОВАНИЯМИ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения
ПК-5.2. Способен анализировать риски и выстраивать процесс управления ими в системе экономической безопасности	ПК-5.2.3 Планирует этапы управления различными видами рисков	Знать: элементы системы управления рисками хозяйствующих субъектов; принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов; этапы управления рисками в рамках функционирования систем управления рисками
		Уметь: использовать данные о деятельности хозяйствующего субъекта в процессе планирования систем управления рисками; планировать процесс управления рисками с учетом возможностей комплексных и интегрированных систем управления рисками; планировать процесс управления рисками в рамках проектирования систем управления
		Владеть: навыками интерпретировать результаты анализа и оценки деятельности хозяйствующих субъектов для проектирования систем управления рисками; навыками формирования прогнозных значений и показателей процесса управления рисками в целях проектирования систем управления ими; навыками оценки эффективности функционирования процесса управления рисками в рамках функционирования систем управления рисками
ПК-5.4. Способен проектировать систему управления рисками в соответствии с особенностями деятельности и осуществляемыми бизнес-процессами	ПК-5.4.1 Разрабатывает систему управления рисками и обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов	Знать: принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов; методическую базу функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов
		Уметь: планировать процесс проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов; разрабатывать систему управления рисками хозяйствующих субъектов
		Владеть: общей методологией анализа деятельности хозяйствующих субъектов в целях проектирования систем управления рисками; навыками оценки эффективности разработанной системы управления рисками
	ПК-5.4.2 Проектирует систему управления рисками с учетом бизнес-процессов и особенностей деятельности хозяйствующих субъектов	Знать: виды и особенности бизнес-процессов хозяйствующих субъектов в рамках проектирования систем управления рисками
		Уметь: учитывать особенности бизнес-процессов и деятельности хозяйствующих субъектов при проектировании систем управления рисками; анализировать бизнес-процессы хозяйствующих субъектов для проектирования систем управления рисками
		Владеть: навыками оценки результатов анализа бизнес-процессов хозяйствующих субъектов для проектирования систем управления рисками

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ							
Код	Наименование разделов, тем и видов работы	Очная форма				*Код индикатора достижения компетенции	
		Семестр	Часы				
			Лек	Пр	Лаб		СР
1.0	Раздел 1. Теоретические основы систем управления рисками хозяйствующих субъектов						
1.1	Система управления рисками хозяйствующих субъектов: принципы и элементы	7	2	4		8	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
1.2	Интегрированный, комплексный и адаптивный риск-менеджмент	7	2	4		8	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
1.3	Стратегическое управление рисками в системе управления рисками	7	2	4		12	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
2.0	Раздел 2. Методические аспекты проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов						
2.1	Принципы реализации функциональной системы управления рисками	7	2	4		10	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
2.2	Оценка эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	7	2	4		8	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
3.0	Раздел 3. Проектирование систем управления рисками с учетом бизнес-процессов хозяйствующих субъектов						
3.1	Принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	7	2	4		8	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
3.2	Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса	7	2	4/4		12	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
	Итого	7	14	28/4		66	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
	Форма промежуточной аттестации – зачет	7					ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
3.3	Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков в целях проектирования системы управления рисками. Мутация рисков	8	2	4		5	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
3.4	Бизнес-процессы: понятие и сущность	8	2	4		5	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
3.5	Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов. Взаимосвязь системы управления рисками и бизнес-процессов	8	4	8		12	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
4.0	Раздел 4. Политика управления рисками						
4.1	Разработка политики управления рисками	8	2	4/4		7	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
4.2	Процессный подход к проектированию систем управления рисками	8	2	4		7	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
	Выполнение курсовой работы	8				36	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2
	Итого	8	12	24/4		72	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1

						ПК-5.4.2
	Форма промежуточной аттестации – экзамен	8		36		ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2

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: оформлен в виде приложения № 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% онлайн		
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]. – http://znanium.com/catalog/product/563779	Москва : ИНФРА-М, 2017	100% online		
6.1.1.2	Серебрякова Т. Ю.	Риски организации и внутренний экономический контроль : монография [Электронный ресурс]. – http://znanium.com/catalog/product/940810	Москва : ИНФРА-М, 2018	100% online		
6.1.2 Дополнительная литература						
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год издания	Кол-во экз. в библиотеке/ 100% онлайн		
6.1.2.1	Хоминич И. П.	Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов [Электронный ресурс]. – https://urait.ru/bcode/489981	Москва : Издательство Юрайт, 2022	100% online		
6.1.2.2	Царьков И.Н.; введение Аньшина В.М.	Математические модели управления проектами : учебник [Электронный ресурс]. – http://znanium.com/catalog/product/991895	Москва : ИНФРА-М, 2019	100% online		
6.1.2.3	Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С	Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие [Электронный ресурс]. – http://znanium.com/catalog/product/415224	Москва : Дашков и К, 2017	100% online		
6.1.2.4	Антонов Г.Д., Иванова О.П., Тумин В.М.	Управление рисками организации: Учебное пособие [Электронный ресурс]. – http://znanium.com/catalog/product/475625	Москва : НИЦ ИНФРА-М, 2015	100% online		
6.1.3 Учебно-методические разработки (в т. ч. для самостоятельной работы обучающихся)						
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год издания/ Личный кабинет обучающегося	Кол-во экз. в библиотеке/ 100% онлайн		
6.1.3.1	Малахова А.А.	Методические материалы и указания по изучению дисциплины	Личный кабинет обучающегося, ЭИОС	100% онлайн		
6.2 Ресурсы 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, 2013-2023. – URL: http://umczdt.ru/books/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный.
6.2.3	Znanium.com : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «ЗНАНИУМ». – Москва. 2011-2023. – URL: http://znanium.com . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный.
6.2.4	Образовательная платформа Юрайт : электронная библиотека : сайт / ООО «Электронное издательство Юрайт». – Москва, 2020-2023. – URL: https://urait.ru/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный
6.2.5	Университетская библиотека онлайн : электронная библиотека : сайт / ООО «Директ-Медиа». – Москва, 2006-2023. – 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://sdo.krsk.irkups.ru/ . – Текст: электронный.
6.2.7	Российские железные дороги : официальный сайт / ОАО «РЖД». – Москва, 2003-2023. – URL: http://www.rzd.ru/ . – Текст: электронный.
6.2.8	Национальная электронная библиотека : федеральный проект : сайт / Министерство Культуры РФ. – Москва, 2016-2023. – URL: https://rusneb.ru/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный

6.3 Программное обеспечение и информационные справочные системы

6.3.1 Базовое программное обеспечение

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 Специализированное программное обеспечение

6.3.2.1	Не используется
---------	-----------------

6.3.3 Информационные справочные системы

6.3.3.1	Красноярский центр научно-технической информации и библиотек (КрЦНТИБ) : сайт. – Красноярск. – URL: http://denti.krw.rzd . – Режим доступа: из локальной сети вуза. – Текст : электронный
6.3.3.2	Гарант : справочно-правовая система база данных / ООО «ИПО «ГАРАНТ». – Режим доступа : из локальной сети вуза. – Текст : электронный.
6.3.3.3	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 УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

1	Корпуса А, Л, Т, Н КрИЖТ ИрГУПС находятся по адресу г. Красноярск, ул. Новая Заря, д. 2 И
2	Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых проектов, работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, укомплектованные специализированной мебелью и техническими средствами обучения (ноутбук, проектор, экран), служащими для представления учебной информации большой аудитории. Для проведения занятий лекционного типа имеются учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты, таблицы), обеспечивающие тематические иллюстрации содержания дисциплины.
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; – компьютерные классы А-224, А-409, А-414, Л-203, Л-204, Л-214, Л-404, Л-410, Н-204, Н-207, Т-46, Т-5.

8 МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Вид учебной деятельности	Организация учебной деятельности обучающегося
Лекция	Лекция (от латинского «lectio» – чтение) – вид аудиторных учебных занятий. Лекция: закладывает основы научных знаний в систематизированной, последовательной, обобщенной форме; раскрывает состояние и перспективы развития соответствующей области науки и техники; концентрирует внимание обучающихся на наиболее сложных, узловых вопросах; стимулирует познавательную активность обучающихся.

	<p>Во время лекционных занятий обучающийся должен уметь сконцентрировать внимание на изучаемых проблемах и включить в работу все виды памяти: словесную, образную и моторно-двигательную. Для этого весь материал, излагаемый преподавателем, обучающемуся необходимо конспектировать. В конспект рекомендуется выписывать определения, формулировки, формулы и т.п. На полях конспекта следует пометить вопросы, выделенные обучающимся для консультации с преподавателем. Выводы, полученные в виде формул, рекомендуется в конспекте подчеркивать или обводить рамкой, чтобы лучше запоминались. Полезно составить краткий справочник, содержащий определения важнейших понятий и наиболее часто употребляемые формулы дисциплины. К каждой лекции следует разобрать материал предыдущей лекции. Изучая материал по учебнику или конспекту лекций, следует переходить к следующему вопросу только в том случае, когда хорошо усвоен предыдущий вопрос. При этом необходимо воспроизводить на бумаге все рассуждения, как имеющиеся в учебнике или конспекте, так и пропущенные в силу их простоты. Ряд вопросов дисциплины может быть вынесен на самостоятельное изучение. Такое задание требует оперативного выполнения. В конспекте лекций необходимо оставить место для освещения упомянутых вопросов. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, то необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии</p>
<p>Практическое занятие</p>	<p>Практическое занятие – вид аудиторных учебных занятий, целенаправленная форма организации учебного процесса, при реализации которой обучающиеся по заданию и под руководством преподавателя выполняют практические задания. Практические задания направлены на углубление научно-теоретических знаний и овладение определенными методами работы, в процессе которых вырабатываются умения и навыки выполнения тех или иных учебных действий в данной сфере науки. Практические занятия развивают научное мышление и речь, позволяют проверить знания обучающихся, выступают как средства оперативной обратной связи; цель практических занятий – углублять, расширять, детализировать знания, полученные на лекции, в обобщенной форме и содействовать выработке навыков профессиональной деятельности.</p> <p>На практических занятиях подробно рассматриваются основные вопросы дисциплины, разбираются основные типы задач. К каждому практическому занятию следует заранее самостоятельно выполнить домашнее задание и выучить лекционный материал к следующей теме. Систематическое выполнение домашних заданий обязательно и является важным фактором, способствующим успешному усвоению дисциплины.</p> <p>Особое внимание следует обращать на определение основных понятий дисциплины. Обучающийся должен подробно разбирать примеры, которые поясняют понятия.</p> <p>Практическая подготовка, включаемая в практические занятия, предполагает выполнение обучающимися отдельных элементов, связанных с будущей профессиональной деятельностью (поддержка процесса управления рисками)</p>
<p>Самостоятельная работа</p>	<p>Обучение по дисциплине «Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов» предусматривает активную самостоятельную работу обучающегося. На самостоятельную работу отводится 138 часов по очной форме обучения. В разделе 4 рабочей программы, который называется «Структура и содержание дисциплины», все часы самостоятельной работы расписаны по темам и вопросам, а также указана необходимая учебная литература: обучающийся изучает учебный материал, разбирает примеры и решает разноуровневые задачи в рамках выполнения как общих домашних заданий, так и индивидуальных домашних заданий (ИДЗ). При выполнении домашних заданий обучающемуся следует обратиться к задачам, решенным на предыдущих практических занятиях, решенным домашним работам, а также к примерам, приводимым лектором. Если этого будет недостаточно для выполнения всей работы можно дополнительно воспользоваться учебными пособиями, приведенными в разделе 6.1 «Учебная литература». Если, несмотря на изученный материал, задание выполнить не удастся, то в обязательном порядке необходимо посетить консультацию преподавателя, ведущего практические занятия, и/или консультацию лектора.</p> <p>ИДЗ должны быть выполнены обучающимся в установленные преподавателем сроки в соответствии с требованиями к оформлению КР (текстовой и графической частей), сформулированным в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль».</p> <p>Обучающийся очной формы обучения выполняет: 8 семестр Курсовая работа. Задания размещены в электронной информационно-образовательной среде КрИЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.</p>

Курсовая работа	<p>Представляет собой форму отчетности по самостоятельной работе студента и содержит систематизированные сведения по определенной теме выводы по заданной в курсовой работе теме. Изучение научной, учебной, нормативной и другой литературы. Отбор необходимого материала. Проведение требуемых расчетов по материалам объекта исследования (предприятия, региона); формирование выводов и разработка конкретных рекомендаций по решению поставленной задачи. Курсовая работа должна быть выполнена обучающимся в установленные преподавателем сроки в соответствии с требованиями к оформлению КР (текстовой и графической частей), сформулированным в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль».</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.</p>	

**Приложение 1 к рабочей программе по дисциплине
Б1.В.ДВ.08.01 Проектирование систем управления рисками
хозяйствующих субъектов**

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

**Б1.В.ДВ.08.01 Проектирование систем управления
рисками хозяйствующих субъектов**

1. Общие положения

Фонд оценочных средств (ФОС) является составной частью нормативно-методического обеспечения системы оценки качества освоения обучающимися образовательной программы.

Фонд оценочных средств предназначен для использования обучающимися, преподавателями, администрацией КрИЖТ ИрГУПС, а также сторонними образовательными организациями для оценивания качества освоения образовательной программы и уровня сформированности компетенций у обучающихся.

Задачами ФОС являются:

- оценка достижений обучающихся в процессе изучения дисциплины;
- обеспечение соответствия результатов обучения задачам будущей профессиональной деятельности через совершенствование традиционных и внедрение инновационных методов обучения в образовательный процесс;
- самоподготовка и самоконтроль обучающихся в процессе обучения.

Фонд оценочных средств сформирован на основе ключевых принципов оценивания: валидность, надежность, объективность, эффективность.

Для оценки уровня сформированности компетенций используется трехуровневая система:

- минимальный уровень освоения, обязательный для всех обучающихся по завершению освоения образовательной программы; дает общее представление о виде деятельности, основных закономерностях функционирования объектов профессиональной деятельности, методов и алгоритмов решения практических задач;
- базовый уровень освоения, превышение минимальных характеристик сформированности компетенций; позволяет решать типовые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения по известным алгоритмам, правилам и методикам;
- высокий уровень освоения, максимально возможная выраженность характеристик компетенций; предполагает готовность решать практические задачи повышенной сложности, нетиповые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения в условиях неполной определенности, при недостаточном документальном, нормативном и методическом обеспечении.

2. Перечень компетенций, в формировании которых участвует дисциплина.

Программа контрольно-оценочных мероприятий. Показатели оценивания компетенций, критерии оценки

Дисциплина «Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов» участвует в формировании компетенций:

ПК-5.2. Способен анализировать риски и выстраивать процесс управления ими в системе экономической безопасности

ПК-5.4. Способен проектировать систему управления рисками в соответствии с особенностями деятельности и осуществляемыми бизнес-процессами

Программа контрольно-оценочных мероприятий очная форма обучения

№	Неделя	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля (понятие/тем/раздел и т.д. дисциплины)	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
7 семестр					
1	1-2	Текущий контроль	1.1 Система управления рисками хозяйствующих субъектов: принципы и элементы	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно)
2	3-4	Текущий контроль	1.2 Интегрированный, комплексный и адаптивный риск-менеджмент	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно)
3	5-6	Текущий контроль	1.3 Стратегическое управление рисками в системе управления рисками	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно)
4	7-8	Текущий контроль	2.1 Принципы реализации функциональной системы управления рисками	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно)
5	9-10	Текущий контроль	2.2 Оценка эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно)
6	11-12	Текущий контроль	3.1 Принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно)
7	13-14	Текущий контроль	3.2 Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно) В рамках ПП**: творческое задание (письменно)
8	14	Текущий контроль	Темы 1.1 – 3.2	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Тестирование (компьютерные технологии)
9	14	Промежуточная аттестация – зачет	Темы 1.1 – 3.2	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно), разноуровневые задания (письменно)
8 семестр					
10	1-2	Текущий контроль	3.3 Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков в целях проектирования системы управления рисками. Мутация рисков	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование, разноуровневые задания (устно, письменно)
11	3-4	Текущий контроль	3.4 Бизнес-процессы: понятие и сущность	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование, разноуровневые задания (устно, письменно)
12	5-6	Текущий контроль	3.5 Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов. Взаимосвязь системы управления рисками и бизнес-процессов	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование, разноуровневые задания (устно, письменно)
13	7-8	Текущий контроль	4.1 Разработка политики управления рисками	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно) В рамках ПП**: творческое задание (письменно)
14	9-10	Текущий контроль	4.2 Процессный подход к проектированию систем управления рисками	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование (устно)

№	Неделя	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля (понятие/тем/раздел и т.д. дисциплины)	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
15	10	Текущий контроль	Темы 3.3 – 4.2	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Тестирование (компьютерные технологии)
16	1-12	Курсовая работа	Раздел 1. Общие положения системы управления рисками хозяйствующих субъектов Раздел 2. Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Темы курсовых работ (письменно), устный опрос при защите (устно)
17	13-14	Промежуточная аттестация - экзамен	Раздел 1. Общие положения системы управления рисками хозяйствующих субъектов Раздел 2. Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов	ПК-5.2.3 ПК-5.4.1 ПК-5.4.2	Собеседование по экзаменационному билету (устно)

*Форма проведения контрольно-оценочного мероприятия: устно, письменно, компьютерные технологии.

**ППП – практическая подготовка.

Описание показателей и критериев оценивания компетенций.

Описание шкал оценивания

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

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

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

Перечень оценочных средств, используемых для оценивания компетенций, а также краткая характеристика этих средств приведены в таблице

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	Собеседование	Средство контроля на практическом занятии, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Может быть использовано для оценки знаний обучающихся	Вопросы по темам/разделам дисциплины
2	Творческое задание	Частично регламентированное задание, имеющее нестандартное решение и позволяющее диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения. Может выполняться в индивидуальном порядке или группой обучающихся. Может быть использовано для оценки знаний, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Темы типовых групповых и/или индивидуальных творческих заданий
3	Разноуровневые задания	Различают задачи и задания: – реконструктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения синтезировать, анализировать, обобщать	Комплект типовых

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
		фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся; – творческого уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	разноуровневых заданий
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. Может выполняться в индивидуальном порядке или группой обучающихся. Может быть использовано для оценки умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся в предметной или межпредметной областях	Темы типовых групповых и / или индивидуальных проектов и типовое задание на курсовой проект (работу)
5	Тестирование	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 по дисциплине
6	Зачет	Средство, позволяющее оценить знания, умения и владения обучающегося по дисциплине. Рекомендуется для оценки знаний, умений и владений навыками обучающихся	Перечень теоретических вопросов и практических заданий к зачету
7	Экзамен	Средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Перечень теоретических вопросов и типовых практических заданий (билетов) к экзамену

Критерии и шкалы оценивания компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета и экзамена. Шкала оценивания уровня освоения компетенций

Шкалы оценивания		Критерии оценивания	Уровень освоения компетенции
«отлично»	«зачтено»	Обучающийся правильно ответил на теоретические вопросы. Показал отличные знания в рамках учебного материала. Правильно выполнил практические задания. Показал отличные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на все дополнительные вопросы	Высокий
«хорошо»		Обучающийся с небольшими неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал хорошие знания в рамках учебного материала. С небольшими неточностями выполнил практические задания. Показал хорошие умения и	Базовый

		владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на большинство дополнительных вопросов	
«удовлетворительно»		Обучающийся с существенными неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал удовлетворительные знания в рамках учебного материала. С существенными неточностями выполнил практические задания. Показал удовлетворительные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Допустил много неточностей при ответе на дополнительные вопросы	Минимальный
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Обучающийся при ответе на теоретические вопросы и при выполнении практических заданий продемонстрировал недостаточный уровень знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. При ответах на дополнительные вопросы было допущено множество неправильных ответов	Компетенция не сформирована

Критерии и шкалы оценивания результатов обучения при проведении текущего контроля успеваемости

Собеседование

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

Задания реконструктивного уровня

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	Обучающийся полностью и правильно выполнил задания. Показал отличные знания, умения и владения навыками применения их при решении задач в рамках усвоенного учебного материала. Работа оформлена аккуратно и в соответствии с предъявляемыми требованиями
«хорошо»	Обучающийся выполнил задания с небольшими неточностями. Показал хорошие знания, умения и владения навыками применения их при решении задач в рамках усвоенного учебного материала. Есть недостатки в оформлении работы
«удовлетворительно»	Обучающийся выполнил задания с существенными неточностями. Показал удовлетворительные знания, умения и владения навыками применения их при решении задач в рамках усвоенного учебного материала. Качество оформления работы имеет недостаточный уровень
«неудовлетворительно»	При выполнении заданий обучающийся продемонстрировал недостаточный уровень знаний, умений и владения ими при решении задач в рамках усвоенного учебного материала

Творческое задание

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	<p>Представленная работа демонстрирует точное понимание задания и полное ему соответствие. В работе приводятся конкретные факты и примеры.</p> <p>Материал изложен логично. Работа и форма её представления является авторской, выполнена самостоятельно и содержит большое число оригинальных, изобретательных примеров.</p> <p>Эффективное использование изображений, видео, аудио и других мультимедийных возможностей, чтобы представить свою тему и вызвать интерес. Презентация имеет все необходимые разделы, данные об авторе, ссылки на источники, оформлена в одном стиле. Текст не избыточен на слайде, не имеет орфографических и речевых ошибок</p>
«хорошо»	<p>Представленная работа демонстрирует понимание задания. В работу включаются как материалы, имеющие как непосредственное отношение к теме, так и материалы, не имеющие отношения к ней. Содержание работы соответствует заданию, но не все аспекты задания раскрыты. В работе есть элементы творчества.</p> <p>Используются однотипные мультимедийные возможности, или некоторые из них отвлекают внимание от темы презентации. Основные требования к презентации соблюдены, но отсутствует выполнение требований либо к оформлению, либо к содержанию. Текст на слайде не избыточен, но плохо читается, несколько неудачных речевых выражений.</p>
«удовлетворительно»	<p>В работу включена собранная обучающимся информация, но она не анализируется и не оценивается. Нарушение логики в изложении материала. Обычная, стандартная работа, элементы творчества отсутствуют.</p> <p>Не используются изображения, видео, аудио и другие мультимедийные возможности, или их использование отвлекает внимание. Не соблюдены требования к оформлению презентации. Слишком много текста, или две и более орфографических ошибок, или речевые и орфографические ошибки</p>
«неудовлетворительно»	<p>Включены материалы, не имеющие непосредственного отношения к теме работы, содержание работы не относится в рассматриваемой проблеме. Отсутствует логики в изложении материала. Не используются изображения, видео, аудио и другие мультимедийные возможности, или их использование отвлекает внимание. Не соблюдены требования к оформлению презентации</p>

Курсовая работа

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	<ul style="list-style-type: none"> – содержание и оформление курсового проекта (работы) соответствует требованиям методических указаний и теме проекта (работы); – курсовой проект (работа) актуален, выполнен самостоятельно, имеет творческий характер, отличается определенной новизной; – в курсовом проекте (работе) дан обстоятельный анализ степени теоретического исследования проблемы, различных подходов к ее решению; – в докладе и ответах на вопросы обучающийся показал знание нормативной базы, учтены последние изменения в законодательстве и нормативных документах по данной проблеме; – проблема раскрыта глубоко и всесторонне, материал изложен логично; – теоретические положения органично сопряжены с практикой; даны представляющие интерес практические рекомендации, вытекающие из анализа проблемы; – в курсовом проекте (работе) широко используются материалы исследования, проведенного обучающимся самостоятельно или в составе группы (в отдельных случаях допускается опора на вторичный анализ имеющихся данных); – в курсовом проекте (работе) проведен количественный анализ проблемы, который подкрепляет теорию и иллюстрирует реальную ситуацию, приведены таблицы сравнений, графики, диаграммы, формулы, показывающие умение обучающегося формализовать результаты исследования; – широко представлен список использованных источников по теме проекта (работы); – приложения к работе иллюстрируют достижения обучающегося и подкрепляют его выводы; – по своему содержанию и форме курсовой проект (работа) соответствует всем предъявленным требованиям

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«хорошо»	<ul style="list-style-type: none"> – содержание и оформление курсового проекта (работы) соответствует требованиям методических указаний; – содержание курсового проекта (работы) в целом соответствует заявленной теме; – курсовой проект (работа) актуален, написан самостоятельно; – в курсовом проекте (работе) дан анализ степени теоретического исследования проблемы; – в докладе и ответах на вопросы основные положения курсового проекта (работы) раскрыты на хорошем или достаточном теоретическом и методологическом уровне; – теоретические положения сопряжены с практикой; – представлены количественные показатели, характеризующие проблемную ситуацию; – практические рекомендации обоснованы; – приложения грамотно составлены и прослеживается связь с положениями курсового проекта (работы); – составлен список использованных источников по теме курсового проекта (работы)
«удовлетворительно»	<ul style="list-style-type: none"> – содержание и оформление курсового проекта (работы) соответствует требованиям методических указаний; – имеет место определенное несоответствие содержания курсового проекта (работы) заявленной теме; – в докладе и ответах на вопросы исследуемая проблема в основном раскрыта, но не отличается новизной, теоретической глубиной и аргументированностью, имеются не точные или не полностью правильные ответы; – нарушена логика изложения материала, задачи раскрыты не полностью; – в курсовом проекте (работе) не полностью использованы необходимые для раскрытия темы научная литература, нормативные документы, а также материалы исследований; – теоретические положения слабо увязаны с управленческой практикой, практические рекомендации носят формальный бездоказательный характер;
«неудовлетворительно»	<ul style="list-style-type: none"> – содержание и оформление курсового проекта (работы) не соответствует требованиям методических указаний; – содержание курсового проекта (работы) не соответствует ее теме; – в докладе и ответах на вопросы даны в основном неверные ответы; – курсовой проект (работа) содержит существенные теоретико-методологические ошибки и поверхностную аргументацию основных положений; – курсовой проект (работа) носит умозрительный и (или) компилятивный характер

Критерии и шкала оценивания тестов

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

3.1 Типовые вопросы для собеседования

Вопросы выложены в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведены образцы типовых вопросов для собеседования по темам, предусмотренных рабочей программой.

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Система управления рисками хозяйствующих субъектов: принципы и элементы»

1. Сущность системы управления рисками хозяйствующих субъектов.
2. Отличительные особенности системы управления рисками и процесса управления рисками.
3. Принципы системы управления рисками хозяйствующих субъектов.
4. Элементы системы управления рисками хозяйствующих субъектов.
5. Взаимовлияние элементов системы управления рисками хозяйствующих субъектов.

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Интегрированный, комплексный и адаптивный риск-менеджмент»

1. Сущность риск-менеджмента как науки.
2. Сущность риск-менеджмента как направления деятельности хозяйствующих субъектов.
3. Адаптивный риск-менеджмент.
4. Комплексный риск-менеджмент.
5. Интегрированный риск-менеджмент.

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Стратегическое управление рисками в системе управления рисками»

1. Стратегии управления рисками в системе управления рисками.
2. Стратегия трансформации в управлении рисками.
3. Стратегия финансирования в управлении рисками.
4. Методы управления рисками в стратегии трансформации.
5. Методы управления рисками в стратегии финансирования

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Принципы реализации функциональной системы управления рисками»

1. Сущность и содержание функциональной системы управления рисками.
2. Отличительные особенности функциональной системы управления рисками.
3. Принципы реализации функциональной системы управления рисками.
4. Элементы функциональной системы управления рисками.
5. Взаимовлияние элементов функциональной системы управления рисками.

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Оценка эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов»

1. Сущность и содержание эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов.
2. Отличительные особенности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов.
3. Принципы эффективного функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов.
4. Критерии оценки эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов

Образец типовых вопросов для собеседования

по теме «Принципы и этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов»

1. Сущность и содержание проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов.
2. Отличительные особенности проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов.
3. Принципы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов.
4. Элементы систем управления рисками хозяйствующих субъектов.
5. Этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов и их взаимосвязь.

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса»

1. Сущность и содержание рисков для ключевых стейкхолдеров бизнеса.
2. Отличительные особенности рисков ключевых стейкхолдеров бизнеса.
3. Принципы эффективного функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов с позиции ключевых стейкхолдеров бизнеса.
4. Критерии оценки эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов с позиции ключевых стейкхолдеров бизнеса

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков в целях проектирования системы управления рисками. Мутация рисков»

1. Сущность и содержание различных групп рисков при проектировании системы управления рисками.
2. Мутация рисков и причины этого явления
3. Принципы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов с учетом системного взаимного влияния различных групп рисков.
4. Подходы к управлению рисками хозяйствующих субъектов с учетом системного взаимного влияния различных групп рисков.
5. Этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов с учетом системного взаимного влияния различных групп рисков.

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов. Взаимосвязь системы управления рисками и бизнес-процессов»

1. Сущность и содержание процесса управления рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов.
2. Принципы управления рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов.
3. Взаимосвязь системы управления рисками и бизнес-процессов.
4. Критерии оценки эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов.

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Разработка политики управления рисками»

1. Сущность и содержание политики управления рисками.
2. Отличительные особенности разработка политики управления рисками.
3. Принципы разработка политики управления рисками хозяйствующих субъектов.
4. Элементы политики управления рисками хозяйствующих субъектов.

5.Этапы разработки политики управления рисками хозяйствующих субъектов и их взаимосвязь.

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Процессный подход к проектированию систем управления рисками»

- 1.Сущность и содержание процессного подхода к проектированию систем управления рисками.
- 2.Отличительные особенности процессного подхода к проектированию систем управления рисками.
- 3.Принципы реализации процессного подхода к проектированию систем управления рисками.
- 4.Этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов на основе процессного подхода.

3.2 Типовые контрольные задания творческого уровня, выполняемые в рамках практической подготовки

Варианты заданий выложены в электронной информационно-образовательной среде КРИЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведены образцы типовых вариантов творческих заданий, предусмотренных рабочей программой.

Образец типового варианта творческого задания, выполняемого в рамках практической подготовки,

по теме «Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса»

(*трудовая функция В/03.6: Оказание методической помощи и поддержка процесса управления рисками для ответственных за риск сотрудников организации - владельцев риска; трудовая функция В/04.6: Разработка методической и нормативной базы системы управления рисками и принципов управления рисками в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений*)

Задание: Проанализировать риски стейкхолдеров объекта исследования и выявить меры, направленные на минимизацию этих рисков:

Стейкхолдеры	Ценности, подверженные риску					
	Финансовая устойчивость	Денежный поток	Нематериальные активы	Деловые отношения	Физическая безопасность	Эффективный менеджмент
Акционеры						
Кредиторы						
Поставщики						
Покупатели						
Персонал						
Государство						
Страховщики						
Конкуренты						

Образец типового варианта творческого задания, выполняемого в рамках практической подготовки,

по теме «Разработка политики управления рисками»

(*трудовая функция В/03.6: Оказание методической помощи и поддержка процесса управления рисками для ответственных за риск сотрудников организации - владельцев риска; трудовая функция В/04.6: Разработка методической и нормативной базы системы управления рисками и принципов управления рисками в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений*)

Задание: разработать политику управления рисками организации (по основным параметрам и характеристикам). В политику управления рисками включить следующие положения:

- цель и задачи системы управления рисками
- принципы управления рисками
- классификация рисков
- элементы системы управления рисками
- процессы управления рисками
- организационная структура управления рисками
- структура нормативной документации по управлению рисками

3.3 Типовые контрольные задания реконструктивного уровня

Задания выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведены образцы типовых вариантов заданий реконструктивного уровня, предусмотренных рабочей программой.

Образец типового варианта заданий реконструктивного уровня
по теме «Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков в целях проектирования системы управления рисками»

Составить матрицу взаимного влияния рисков

Вторичный риск	Первичный риск				
	Технико-технологический	Рыночный	Ликвидности	Кредитный	Организационно-управленческий
Технико-технологический	В соответствии с концепцией интегрированного риск-менеджмента в ячейках матрицы следует отразить рычаги взаимного влияния рисков различной природы				
Рыночный					
Ликвидности					
Кредитный					
Организационно-управленческий					

Образец типового варианта заданий реконструктивного уровня
по теме «Бизнес-процессы: понятие и сущность»

Задание. На основании данных о деятельности организации, а также анализа ее деятельности, необходимо представить основные бизнес-процессы.

Основные бизнес-процессы деятельности ПАО «...»

Бизнес-процесс	Сущность бизнес-процесса	Результат реализации бизнес-процесса	Сотрудник, отвечающий за бизнес-процесс
1			
2			

3			
4			

Образец типового варианта заданий реконструктивного уровня по теме «Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов. Взаимосвязь системы управления рисками и бизнес-процессов»

Задание. На основании данных о деятельности организации, а также анализа ее деятельности, необходимо представить основные бизнес-процессы и их взаимосвязь с рисками.

Взаимосвязь бизнес-процессов деятельности ПАО «...» и рисков

Бизнес-процесс	Сущность бизнес-процесса	Риски в данном бизнес-процессе	Негативное влияние риска в случае реализации
1		1 риск	
		...	
...		1 риск	
		...	

3.4 Типовое задание на курсовую работу

Основной целью курсовой работы является анализ фактических эмпирических данных о системах управления рисками хозяйствующих субъектов и формирование управленческих решений, направленных на повышение эффективности этих систем.

Обучающийся самостоятельно выбирает объект исследования (Публичное акционерное общество) курсовой работы из списка:

1. Газпром
2. АФК Система
3. Новатэк
4. Магнит
5. Норильский никель
6. Роснефть
7. Северсталь
8. Сургутнефтегаз
9. Транснефть
10. МТС
11. Алроса
12. Яндекс
13. Ростелеком
14. ФОСАГРО
15. Уралкалий
16. НЛМК
17. Мегафон
18. РусГидро
19. Башнефть
20. Полюс
21. Аэрофлот
22. Интер РАО
23. РусАЛ
24. ФСК ЕЭС
25. Мостотрест
26. Лента

27. Мечел
28. Иркутскэнерго
29. АвтоВАЗ
30. Соллерс

На основании данных о деятельности выбранной организации обучающийся должен осуществить следующие аналитические процедуры:

1. Анализ деятельности объекта исследования. Данное задание включает в себя анализ основных видов деятельности, объемных показателей (физические показатели деятельности, выручка, чистая прибыль, капитализация и т.д.), структуры собственников и принципов взаимодействия с ними, рынков и географических сегментов присутствия.

2. Анализ профиля рисков объекта исследования.

В первую очередь, осуществляется анализ угроз для стейкхолдеров объекта исследования.

Затем, на основании проведенного анализа представить риски деятельности объекта исследования.

Следующим этапом является изучение выявленных и проанализированных рисков в контексте бизнес-процессов объекта исследования.

3. Анализ стратегических преимуществ в области управления рисками

Затем необходимо осуществить анализ стратегических преимуществ, необходимых для управления рисками.

Обучающийся должен проанализировать деятельность объекта исследования с целью выявления наличия перечисленных преимуществ. Результаты следует обобщить в таблице.

Анализ стратегических преимуществ ПАО «...» для управления рисками

Преимущество	Анализ наличия преимуществ в объекте исследования
Наличие информационных преимуществ	
Наличие организационных и технических ресурсов позволяющие гибко реагировать на негативные рисковые ситуации	
Наличие опыта и знаний в рисковом сегменте	
Наличие капитала, его диверсифицированная структура и возможность привлечения дополнительных средств	
Наличие реальных опционов	

Для заполнения таблицы необходимо представить данные о структуре капитала и возможности привлечения дополнительных ресурсов (данные можно взять из ранее выполненных работ по другим дисциплинам).

Здесь же необходимо представить зависимость деятельности организации от общеэкономического состояния страны.

Оценивается регрессионная зависимость совокупной стоимости бизнеса и уровня операционной прибыли от следующих факторов:

- валютного курса;
- уровня инфляции;
- динамики ВВП;
- среднего уровня процентной ставки.

Могут быть использованы другие факторы.

Обучающиеся должны проанализировать регрессионные зависимости прибыли и стоимости бизнеса от перечисленных факторов для того, чтобы оценить степень влияния на результаты деятельности объекта исследования соответственно валютных, рыночных, циклических и финансовых рисков.

В результате проведенного анализа следует сделать вывод о том, есть ли у компании возможности по эффективному управлению рисками.

4. Проектирование системы управления рисками

В первую очередь необходимо представить мероприятия по управлению рисками стейкхолдеров.

На основании приведенной расширенной матрицы стейкхолдеров (получателей) риска (2 глава) необходимо проанализировать мероприятия, которые реализует объект исследования для снижения перечисленных в ячейках таблицы факторов риска.

Основной мотив управления состоит в том, что рост рисков внешней и внутренней среды компании влечет за собой цепную реакцию и, в данном случае, перенос риска на ключевых стейкхолдеров носит лишь кратковременный характер, а в долгосрочной перспективе, повышает вероятность банкротства путем высокой отдачи негативных обратных связей.

В связи с этим ключевые корпорации разрабатывают систему управления рисками с позиции учета интересов ключевых стейкхолдеров. Конкретные мероприятия программ управления рисками зависят от отрасли, используемых источников капитала и зависимости от внешней среды.

В матрицу включены, главным образом, общественные факторы риска, поскольку именно в них можно распознать корпоративные особенности в финансировании и трансформации рисков.

Следующим этапом является анализ используемых методов и способов управления основными рисками организации.

Необходимо дать характеристику представляемым методам и способам.

Затем необходимо составить политику управления рисками (по основным параметрам и характеристикам).

Как правило, в политику управления рисками включаются следующие положения:

- цель и задачи системы управления рисками
- принципы управления рисками
- классификация рисков
- элементы системы управления рисками
- процессы управления рисками
- организационная структура управления рисками
- структура нормативной документации по управлению рисками

После выполнения всей работы необходимо формировать заключение.

3.5 Перечень типовых теоретических вопросов к зачету

1. Сущность адаптивного риск-менеджмента.
2. Сущность комплексного риск-менеджмента.
3. Сущность интегрированного риск-менеджмента. Преимущества системного управления рисками в организации.
4. Практическая направленность моделей и методов интегрированного риск-менеджмента.
5. Характер неопределенности и моделирование систем управления рисками: общие принципы.
6. Факторы риска и модели системного риск-менеджмента.
7. Функции интегрированного риск-менеджмента.
8. Рисковая среда и экономическая безопасность хозяйствующего субъекта.
9. Затраты на реализацию функций интегрированного управления рисками. Экономический эффект от затрат на системы управления рисками.
10. Показатели, характеризующие эффективность системы управления рисками.
11. Анализ эффективности систем управления рисками с точки зрения стоимостного подхода.
12. Методы и модели трансформации риска.

13. Методы и модели финансирования риска.
14. Стратегии управления финансовыми рисками.
15. Стратегии управления технико-технологическими рисками.
16. Стратегии управления организационными рисками.

3.6 Перечень типовых практических заданий к зачету

Задача 1. 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 2. 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 3. 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.

3.7 Типовые тестовые задания

Компьютерное тестирование обучающихся по дисциплине используется при проведении текущего контроля знаний обучающихся.

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)).

Тест по дисциплине формируются из фонда тестовых заданий по дисциплине.

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

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД (с соответствующим номером)	Содержательный элемент	Характеристика содержательного элемента	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
7 семестр				
ПК-5.2.3 Планирует этапы управления различными видами рисков ПК-5.4.1 Разрабатывает систему управления рисками и обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов ПК-5.4.2 Проектирует систему управления рисками с учетом бизнес-процессов и особенностей деятельности хозяйствующих субъектов	1.1 Система управления рисками хозяйствующих субъектов: принципы и элементы	Понятие системы управления рисками хозяйствующих субъектов	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Принципы организации системы управления рисками хозяйствующих субъектов	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Элементы системы управления рисками хозяйствующих субъектов	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	1.2 Интегрированный, комплексный и адаптивный риск-менеджмент	Интегрированный риск-менеджмент	Знание	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Комплексный риск-менеджмент	Умение	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Адаптивный риск-менеджмент	Действие	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
	1.3 Стратегическое управление рисками в системе управления рисками	Стратегия управления рисками в системе стратегического управления предприятием	Знание	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Цели стратегического управления рисками	Умение	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Подходы к формированию стратегии управления рисками	Действие	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
	2.1 Принципы реализации функциональной системы управления рисками	Риски проектов хозяйствующих субъектов	Знание	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Принципы построения функциональной системы управления рисками	Умение	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Подходы к построению функциональной системы управления рисками	Действие	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
	2.2 Оценка эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	Подходы к оценке эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	Знание	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Показатели оценки эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	Умение	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Интегральная оценка эффективности функционирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	Действие	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
3.1 Принципы и этапы проектирования систем управления рисками	Сущность проектного подхода в управлении деятельностью хозяйствующих субъектов	Знание	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ	

	хозяйствующих субъектов	Принципы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	Умение	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Этапы проектирования систем управления рисками хозяйствующих субъектов	Действие	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
	3.2 Риски ключевых стейкхолдеров бизнеса	Понятие риска в системе управления рисками	Знание	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Ключевые стейкхолдеры организации	Умение	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
		Виды рисков ключевых стейкхолдеров бизнеса	Действие	6 – ОТЗ 6 – ЗТЗ
	3.3 Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков в целях проектирования системы управления рисками. Мутация рисков	Источники риска хозяйствующих субъектов	Знание	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
		Анализ системного взаимного влияния различных групп рисков в целях проектирования системы управления рисками	Умение	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
		Мутация рисков	Действие	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
	3.4 Бизнес-процессы: понятие и сущность	Сущность процессного подхода	Знание	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
		Виды процессов в организации	Умение	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
		Бизнес-процессы и их особенности	Действие	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
	3.5 Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов. Взаимосвязь системы управления рисками и бизнес-процессов	Методы управления рисками	Знание	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
		Управление рисками хозяйствующих субъектов с учетом бизнес-процессов	Умение	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
		Взаимосвязь системы управления рисками и бизнес-процессов	Действие	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
	4.1 Разработка политики управления рисками	Политика управления рисками	Знание	10 – ОТЗ 10 – ЗТЗ
		Подходы к разработке политики управления рисками	Умение	12 – ОТЗ 12 – ЗТЗ
		Регламентация риск-менеджмента при разработке политики управления рисками	Действие	12 – ОТЗ 12 – ЗТЗ
	4.2 Процессный подход к проектированию систем управления рисками	Содержание проекта управления рисками	Знание	12 – ОТЗ 12 – ЗТЗ
Регламентация проекта системы управления рисками		Умение	12 – ОТЗ 12 – ЗТЗ	
Процессный подход к проектированию систем управления рисками		Действие	12 – ОТЗ 12 – ЗТЗ	
Итого по дисциплине				280 – ОТЗ 280 – 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 7 (очная) /8 (очно-заочная) семестра,
предусмотренного рабочей программой дисциплины*

Количество – 9 ОТЗ и 9 ЗТЗ.

Норма времени – 45 мин.

1. Что такое риск?

- а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

2. Какие потери можно обозначить как трудовые?

- а) потери рабочего времени
- б) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
- в) уплата дополнительных налогов
- г) невыполнение сроков сдачи объекта
- д) потери материалов
- е) ущерб здоровью
- ж) потери сырья
- з) ущерб репутации
- и) выплата штрафа

3. Какие компании называют кэптивными?

- а) универсальные страховые;
- б) специализированные страховые;
- в) ведомственные страховые.

4. Какие потери можно считать финансовыми?

- а) потери ценных бумаг
- б) потери сырья
- в) невыполнение сроков сдачи объекта
- г) выплата штрафа
- д) уплата дополнительных налогов
- е) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

5. Факторы, которые влияют на уровень финансовых рисков подразделяются на:

- а) объектные и субъектные;
- б) позитивные и негативные;
- в) простые и сложные.

6. Какие потери можно отнести к потерям времени

- а) невыполнение сроков сдачи объекта
- б) потери ценных бумаг
- в) выплата штрафа
- г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию
- д) уплата дополнительных налогов

7. Как называется процесс использования механизмов уменьшения рисков?

- а) диверсификация;

- б) лимитирование;
- в) хеджирование.

8. Что такое анализ риска?

- а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
- б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты
- в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

9. Что является принципом действия механизма диверсификации?

- а) избежание рисков;
- б) разделение рисков;
- в) снижение рисков.

10 Дополните. Следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера - это _____

11 Дополните. Процесс снижения риска за счет увеличения разнообразия видов деятельности, рынков сбыта или каналов поставок - это _____

12 Дополните. В процессе принятия управленческих решений предпринимателю целесообразно различать и выделять определенные области (зоны риска) в зависимости от уровня возможных (ожидаемых) потерь. Для этого разработаны и используются _____ риска

13 Дополните. Риски, которые практически всегда несут в себе потери, называются _____ рисками

14 Дополните. В том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода, заключается _____ функция риска

15 Дополните. Начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик - это _____ риска

16 Дополните. Количественное выражение того, что в результате принятого решения ожидаемый доход будет получен не в полном объеме или будут потеряны предпринимательские ресурсы, - это _____ риска

17 Дополните. В развитой системе риск-менеджмента тактика управления рисками реализуется на основе _____ подхода, при котором оценка риска и реализация рискованных мероприятий происходит по мере возникновения рискованной ситуации с учетом конкретных факторов и условий

18 Дополните. Суть операции _____ заключается в обмене финансовыми активами или обязательствами для улучшения их структуры и снижения возможных потерь

*Образец типового варианта итогового теста 8 (очная) /9 (очно-заочная) семестра,
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

7. 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 _____

3.8. Перечень теоретических вопросов к экзамену

(для оценки знаний)

1. Сущность адаптивного риск-менеджмента.

2. Сущность комплексного риск-менеджмента.

3. Сущность интегрированного риск-менеджмента. Преимущества системного управления рисками в организации.

4. Практическая направленность моделей и методов интегрированного риск-менеджмента.
5. Характер неопределенности и моделирование систем управления рисками: общие принципы.
6. Факторы риска и модели системного риск-менеджмента.
7. Функции интегрированного риск-менеджмента.
8. Рисковая среда и экономическая безопасность хозяйствующего субъекта.
9. Затраты на реализацию функций интегрированного управления рисками. Экономический эффект от затрат на системы управления рисками.
10. Показатели, характеризующие эффективность системы управления рисками.
11. Анализ эффективности систем управления рисками с точки зрения стоимостного подхода.
12. Методы и модели трансформации риска.
13. Методы и модели финансирования риска.
14. Стратегии управления финансовыми рисками.
15. Стратегии управления технико-технологическими рисками.
16. Стратегии управления организационными рисками.
17. Общий подход к организации системы управления рисками: описание матрицы «Человек – система – сила разрушений – источники финансирования»
18. Стейкхолдеры бизнеса. Ключевые риски взаимодействия.
19. Обоснование необходимости управления рисками стейкхолдеров бизнеса. Управление рисками стейкхолдеров для сохранения стратегических ресурсов компании.
20. Система управления рисками персонала.
21. Организационно-управленческие риски. Анализ цены ошибки управленческого персонала.
22. Психологическая природа риска.
23. Система управления технико-технологическими рисками на различных уровнях разрушений.
24. Физический уровень технико-технологических рисков.
25. Технический уровень технико-технологических рисков.
26. Функциональный уровень технико-технологических рисков.
27. Общий подход к управлению финансовыми рисками.
28. Парадокс Боумана. Требования к системе, способной принимать финансовые риски.
29. Особенности применения хеджирования рисков. Анализ оптимального хеджа. Затраты на хеджирование и экономический эффект от хеджирования.

3.9. Перечень типовых простых практических заданий к экзамену

(для оценки умений)

1. Какой вывод можно сделать, если регрессионный анализ не показал зависимости между операционной прибылью компании и динамикой инфляции?
2. Какой вывод можно сделать, если регрессионный анализ не показал зависимости между операционной прибылью и динамикой процентных ставок?
3. Какой вывод можно сделать, если регрессионный анализ показал тесную связь между динамикой рыночной стоимости бизнеса и динамикой ВВП?
4. Какой вывод можно сделать, если регрессионный анализ показал тесную связь между динамикой операционной прибыли и динамикой валютного курса?
5. Какой вывод можно сделать, если регрессионный анализ показал тесную связь между рыночной стоимостью бизнеса и динамикой процентных ставок?
6. Какой вывод можно сделать, если регрессионный анализ показал тесную связь между динамикой рыночной стоимости бизнеса и динамикой валютного курса?
7. Какие методы превентивного управления аварийными ситуациями в физическом элементе сложной технической системы существуют?

8. Если произошла авария на функциональном уровне системы, то какими разрушениями это грозит? Как влияет на уровень экономической безопасности хозяйствующего субъекта?

9. Каков характер разрушений при аварийной ситуации в техническом элементе сложной системы?

10. Приведите примеры защиты глубиной от возникновения рисков сложных технических систем.

11. Приведите примеры защиты временем от возникновения рисков сложных технических систем.

12. В случае реализации природного риска система управления строится по принципу обеспечения безопасности по четырем основным направлениям: человек, среда, импульс разрушений и ресурсы (в том числе, финансовые). Необходимо соотнести с этими направлениями следующие элементы алгоритма управления природным риском:

- А) подрывные работы с целью устранения потенциально опасных объектов,
- Б) расширение безопасных пространств – отсыпка, грейдирование и т.п.,
- В) оказание психологической помощи,
- Г) организация мест временного пребывания пострадавших,
- Д) наказание лиц, изыскивающих личную выгоду из произошедшего,
- Е) сбор финансовой помощи,
- Ж) широкое информирование о происходящих спасательных работах,
- З) быстрая мобилизация тяжелой техники, помощь от военных структур,
- И) восстановление транспортного сообщения

13. Компания анализирует возможности выхода в новый рисковый сегмент рынка. На основе мониторинга рынка выбрано две потенциальных возможности:

- А) самостоятельный выход на рынок, открытие структурного подразделения в рамках компании,
- Б) приобретение дочерней компании, уже занятой в рисковом сегменте.

Необходимо выбрать и обосновать показатели, на основании которых будет сделан вывод о привлекательности каждой из возможностей.

14. Компания анализирует возможность инвестирования в рисковый сегмент, например, строительство отеля в горной местности, где спустя некоторое время состоится крупное спортивное мероприятие. Какие показатели должны быть проанализированы компанией для того, чтобы принять решение о целесообразности капитальных затрат в рисковом сегменте?

15. Компания анализирует возможность инвестирования в рисковый сегмент, например, в строительство частной автодороги. Инвестиционный проект предполагает возможность вывода из него капитала через 2 года в случае получения убытков. Какие аспекты договора необходимо проанализировать для того, чтобы сделать вывод об эффективности такой меры управления риском?

16. Компания занимается ритейлом (розничными продажами товаров народного потребления через сети супермаркетов). В регионе присутствуют федеральные сети супермаркетов, а также региональные сети и локальные магазины. Компания заключила негласные соглашения с федеральными сетями об единой ценовой политике и регламентах проводимых рекламных кампаний. Проанализируйте эффективность этого управленческого решения. В чем предполагаемый эффект с точки зрения управления рисками?

17. Обосновать необходимость управления рисками поставщиков компании с позиции сохранения деловых отношений.

18. Обосновать необходимость управления рисками акционеров с позиции сохранения финансовой устойчивости.

19. Компания подвержена высоким систематическим рискам, но при этом структура собственников очень хорошо диверсифицирована, самый крупный собственник бизнеса

владеет пакетом 15% акций. Обосновать целесообразность или нецелесообразность хеджирования рыночных рисков в такой ситуации.

20. Рисксовая среда компании описывается двумя видами рисков: основная угроза исходит от недобросовестных конкурентов, а также существует вероятность незначительного ущерба от изменения процентных ставок. Какой из этих рисков следует хеджировать? При каких условиях?

3.10 Перечень типовых практических заданий к экзамену (для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

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).

4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

В таблице приведены описания процедур проведения контрольно-оценочных мероприятий и процедур оценивания результатов обучения с помощью оценочных средств в соответствии с рабочей программой дисциплины.

Наименование оценочного средства	Описания процедуры проведения контрольно-оценочного мероприятия и процедуры оценивания результатов обучения
Задания реконструктивного уровня	Выполнение заданий реконструктивного уровня, предусмотренные рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Вариантов заданий по теме не менее пяти. Во время выполнения заданий пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий разрешено. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся: тему, количество заданий и время выполнения заданий
Задания творческого уровня	Выполнение заданий творческого уровня, предусмотренные рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Вариантов заданий по теме не менее пяти. Во время выполнения заданий пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий разрешено. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся: тему, количество заданий и время выполнения заданий
Собеседование	Собеседование проводится на практическом занятии по теме, изученной на лекции. Во время собеседования пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий разрешено. Преподаватель на лекции, предшествующей занятию проведения контроля, доводит до обучающихся: тему и примерные вопросы

Тестирование	Тестирования, предусмотренные рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Тестирование проводится с использованием компьютерных технологий. Варианты тестовых заданий формируются рандомно из базы ТЗ. Во время выполнения заданий пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий не разрешено
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.

Для организации и проведения промежуточной аттестации (в форме зачета) составляются типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы:

- перечень теоретических вопросов к зачету для оценки знаний;
- перечень типовых простых практических заданий к зачету для оценки умений;
- перечень типовых практических заданий к зачету для оценки навыков и (или) опыта деятельности.

Перечень теоретических вопросов и перечни типовых практических заданий разного уровня сложности к зачету обучающиеся получают в начале семестра через электронную информационно-образовательную среду КриЖТ ИрГУПС (личный кабинет обучающегося).

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

При проведении промежуточной аттестации в форме зачета преподаватель может воспользоваться результатами текущего контроля успеваемости в течение семестра. Оценочные средства и типовые контрольные задания, используемые при текущем контроле, позволяют оценить знания, умения и владения навыками/опытом деятельности обучающихся при освоении дисциплины. С целью использования результатов текущего контроля успеваемости, преподаватель подсчитывает среднюю оценку уровня сформированности компетенций обучающегося (сумма оценок, полученных обучающимся, делится на число оценок).

Шкала и критерии оценивания уровня сформированности компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета по результатам текущего контроля (без дополнительного аттестационного испытания)

Средняя оценка уровня сформированности компетенций по результатам текущего контроля	Оценка
Оценка не менее 3,0 и нет ни одной неудовлетворительной оценки по текущему контролю	«зачтено»
Оценка менее 3,0 или получена хотя бы одна неудовлетворительная оценка по текущему контролю	«не зачтено»

Если оценка уровня сформированности компетенций обучающегося не соответствует критериям получения зачета без дополнительного аттестационного испытания, то промежуточная аттестация в форме зачета проводится в форме собеседования по перечню теоретических вопросов и типовых практических задач. Промежуточная аттестация в форме

зачета с проведением аттестационного испытания проходит на последнем занятии по дисциплине.

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 умений, 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» ... семестр	Утверждаю: Заведующий кафедрой УП _____
<p>1 Рисквая среда и экономическая безопасность хозяйствующего субъекта</p> <p>2 Какой вывод можно сделать, если регрессионный анализ показал тесную связь между рыночной стоимостью бизнеса и динамикой процентных ставок?</p> <p>3 Ситуационная 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.</p>		

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.