

Документ подписан простыми электронными подписями  
Информация о владельце:  
ФИО: Сенченко Павел Васильевич  
Должность: Проректор по учебной работе  
Дата подписания: 17.06.2024 18:33:41  
Уникальный программный ключ:  
27e516f4c088deb62ba68945f4406e13fd454355

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования**  
**«ТОМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ СИСТЕМ**  
**УПРАВЛЕНИЯ И РАДИОЭЛЕКТРОНИКИ»**  
**(ТУСУР)**



УТВЕРЖДАЮ  
Проректор по УР

Документ подписан электронной подписью  
Сертификат: a1119608-cdff-4455-b54e-5235117c185c  
Владелец: Сенченко Павел Васильевич  
Действителен: с 17.09.2019 по 16.09.2024

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ**

Уровень образования: **высшее образование - магистратура**  
Направление подготовки / специальность: **38.04.02 Менеджмент**  
Направленность (профиль) / специализация: **Менеджмент в IT-сфере**  
Форма обучения: **очная**  
Факультет: **Экономический факультет (ЭФ)**  
Кафедра: **Кафедра менеджмента (Менеджмента)**  
Курс: **1**  
Семестр: **1**  
Учебный план набора 2024 года

**Объем дисциплины и виды учебной деятельности**

| Виды учебной деятельности          | 1 семестр | Всего | Единицы |
|------------------------------------|-----------|-------|---------|
| Лекционные занятия                 | 12        | 12    | часов   |
| Практические занятия               | 12        | 12    | часов   |
| Самостоятельная работа             | 156       | 156   | часов   |
| Подготовка и сдача экзамена        | 36        | 36    | часов   |
| Общая трудоемкость                 | 216       | 216   | часов   |
| (включая промежуточную аттестацию) | 6         | 6     | з.е.    |

| Формы промежуточной аттестация | Семестр |
|--------------------------------|---------|
| Экзамен                        | 1       |

## 1. Общие положения

### 1.1. Цели дисциплины

1. Формирование у студентов знаний о методах оценки, анализа и управления рисками, а также умений отбирать подходящие методы воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности.

### 1.2. Задачи дисциплины

1. Сформировать знания у обучающихся об основных элементах системы управления финансовыми рисками организации, приемах управления предпринимательскими и финансовыми рисками предприятия, о методах и моделях, используемых в анализе, оптимизации финансовых операций с учетом факторов риска.

2. Сформировать навыки использования в практической деятельности современных специальных экономико-математических инструментов анализа и оценки риска.

3. Сформировать навыки отбора подходящих методов воздействия на отдельные виды рисков и эффективно применять их с учетом их результативности и экономической эффективности.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Блок дисциплин: Б1. Дисциплины (модули).

Часть блока дисциплин: Обязательная часть.

Модуль дисциплин: Модуль направления подготовки (hard skills – HS).

Индекс дисциплины: Б1.О.02.03.

Реализуется с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий.

## 3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО и основной образовательной программой (таблица 3.1):

Таблица 3.1 – Компетенции и индикаторы их достижения

| Компетенция                      | Индикаторы достижения компетенции | Планируемые результаты обучения по дисциплине |
|----------------------------------|-----------------------------------|---|
| <b>Универсальные компетенции</b> |                                   |   |

|  |  |  |
|--|--|--|
| УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий | УК-1.1. Знает методы осуществления критического анализа проблемных ситуаций на основе системного подхода | Знает содержание, цели, задачи и принципы разработки системы управления рисками организации; инструменты и методы управления рисками; общую терминологию в области управления рисками; методологию процесса управления рисками; методы выявления, оценки и анализа уровня рисков, управления рисками.  |
|  | УК-1.2. Умеет разрабатывать стратегии действий на основе критического анализа проблемных ситуаций        | Способен применять аналитические приемы определения целесообразности принятия решений в области управления рисками; классифицировать риски, выявлять особенности их возникновения и управления; проводить выбор между способами передачи рисков, осуществлять соответствующие расчеты к ним; оценивать результативность принятых управленческих решений; определять привлекательность инвестиционного портфеля; пользоваться инструментами риск-менеджмента; отбирать и применять методы воздействия на отдельные виды рисков, оценивать результативность принятых управленческих решений. |
|  | УК-1.3. Владеет навыками разработки стратегии действий на основе системного подхода                      | Владеет методологией экономического исследования; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов; современными методиками расчета и анализа показателей риска; навыками использования методов воздействия на отдельные виды рисков.   |
| <b>Общепрофессиональные компетенции</b>  |  |  |
| -  | -  | -  |
| <b>Профессиональные компетенции</b>  |  |  |
| -  | -  | -  |

**4. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем и на самостоятельную работу обучающихся**

Общая трудоемкость дисциплины составляет 6 зачетных единиц, 216 академических часов.

Распределение трудоемкости дисциплины по видам учебной деятельности представлено в таблице 4.1.

Таблица 4.1 – Трудоемкость дисциплины по видам учебной деятельности

| Виды учебной деятельности   | Всего часов | Семестры  |
|---|-------------|-----------|
|   |             | 1 семестр |
| <b>Контактная аудиторная работа обучающихся с преподавателем, всего</b> | 24          | 24        |
| Лекционные занятия  | 12          | 12        |
| Практические занятия  | 12          | 12        |

|   |     |     |
|---|-----|-----|
| <b>Самостоятельная работа обучающихся, в т.ч. контактная внеаудиторная работа обучающихся с преподавателем, всего</b> | 156 | 156 |
| Подготовка к тестированию   | 36  | 36  |
| Подготовка к устному опросу / собеседованию   | 60  | 60  |
| Написание отчета по практическому занятию (семинару)  | 60  | 60  |
| <b>Подготовка и сдача экзамена</b>  | 36  | 36  |
| <b>Общая трудоемкость (в часах)</b>   | 216 | 216 |
| <b>Общая трудоемкость (в з.е.)</b>  | 6   | 6   |

## 5. Структура и содержание дисциплины

### 5.1. Разделы (темы) дисциплины и виды учебной деятельности

Структура дисциплины по разделам (темам) и видам учебной деятельности приведена в таблице 5.1.

Таблица 5.1 – Разделы (темы) дисциплины и виды учебной деятельности

| Названия разделов (тем) дисциплины         | Лек. зан., ч | Прак. зан., ч | Сам. раб., ч | Всего часов (без экзамена) | Формируемые компетенции |
|--|--------------|---------------|--------------|----------------------------|-------------------------|
| <b>1 семестр</b>                           |              |               |              |                            |                         |
| 1 Целостное управление рисками             | 2            | -             | 16           | 18                         | УК-1                    |
| 2 Риск как объект диагностики и оценки     | 2            | 2             | 31           | 35                         | УК-1                    |
| 3 Управленческий механизм риск-менеджмента | 2            | 4             | 31           | 37                         | УК-1                    |
| 4 Человеческий аспект управления рисками   | 2            | -             | 16           | 18                         | УК-1                    |
| 5 Финансовый аспект управления рисками     | 2            | 2             | 31           | 35                         | УК-1                    |
| 6 Инструментальный ящик риск-менеджера     | 2            | 4             | 31           | 37                         | УК-1                    |
| Итого за семестр                           | 12           | 12            | 156          | 180                        |                         |
| Итого                                      | 12           | 12            | 156          | 180                        |                         |

### 5.2. Содержание разделов (тем) дисциплины

Содержание разделов (тем) дисциплины (в т.ч. по лекциям) приведено в таблице 5.2.

Таблица 5.2 – Содержание разделов (тем) дисциплины (в т.ч. по лекциям)

| Названия разделов (тем) дисциплины | Содержание разделов (тем) дисциплины (в т.ч. по лекциям)   | Трудоемкость (лекционные занятия), ч | Формируемые компетенции |
|------------------------------------|--|--------------------------------------|-------------------------|
| <b>1 семестр</b>                   |  |                                      |                         |
| 1 Целостное управление рисками     | Смысл и ситуация рискования. Рисковый ландшафт и рискованные характеристики организации. Феномен риска. Аспекты риска, потеря. | 2                                    | УК-1                    |
|                                    | Итого  | 2                                    |                         |

|  |   |    |      |
|--|---|----|------|
| 2 Риск как объект диагностики и оценки     | Основы управленческой диагностики рисков. Формула риска. Таксономия рисков. Пирамида риска: факторы, симптомы, бифуркации, контроль.  | 2  | УК-1 |
|  | Итого   | 2  |      |
| 3 Управленческий механизм риск-менеджмента | Модель функции риск-менеджмента в управлении. Распределение обязанностей по управлению рисками. Защита от стратегических рисков. Рутинный риск-менеджмент. Чрезвычайная ситуация. | 2  | УК-1 |
|  | Итого   | 2  |      |
| 4 Человеческий аспект управления рисками   | Индивидуальное и групповое поведение людей и управление рисками. Психологические особенности реакции на риск. Риски работы с кадрами. Оценка рисков аппетита сотрудников.         | 2  | УК-1 |
|  | Итого   | 2  |      |
| 5 Финансовый аспект управления рисками     | Риск, доходность и стоимость фирмы. Методы финансирования программы управления риском. Финансовые инструменты управления рисками.   | 2  | УК-1 |
|  | Итого   | 2  |      |
| 6 Инструментальный ящик риск-менеджера     | Методический арсенал диагностики. Инструментарий управления рисками. Методики оценки политических рисков.   | 2  | УК-1 |
|  | Итого   | 2  |      |
| Итого за семестр                           |   | 12 |      |
| Итого                                      |   | 12 |      |

### 5.3. Практические занятия (семинары)

Наименование практических занятий (семинаров) приведено в таблице 5.3.

Таблица 5.3. – Наименование практических занятий (семинаров)

| Названия разделов (тем) дисциплины         | Наименование практических занятий (семинаров)   | Трудоемкость, ч | Формируемые компетенции |
|--|---|-----------------|-------------------------|
| <b>1 семестр</b>                           |   |                 |                         |
| 2 Риск как объект диагностики и оценки     | Основы оценки риска: использование финансовых и статистических показателей                                | 2               | УК-1                    |
|  | Итого   | 2               |                         |
| 3 Управленческий механизм риск-менеджмента | Анализ и оценка степени риска. Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности | 4               | УК-1                    |
|  | Итого   | 4               |                         |

|  |   |    |      |
|--|---|----|------|
| 5 Финансовый аспект управления рисками | Анализ системы управления рисками в организации                         | 2  | УК-1 |
|  | Итого   | 2  |      |
| 6 Инструментальный ящик риск-менеджера | Комплексная оценка рисков проекта с учетом внешнеэкономических факторов | 4  | УК-1 |
|  | Итого   | 4  |      |
| Итого за семестр                       |   | 12 |      |
| Итого                                  |   | 12 |      |

#### 5.4. Лабораторные занятия

Не предусмотрено учебным планом

#### 5.5. Курсовой проект / курсовая работа

Не предусмотрено учебным планом

#### 5.6. Самостоятельная работа

Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции представлены в таблице 5.6.

Таблица 5.6. – Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции

| Названия разделов (тем) дисциплины         | Виды самостоятельной работы                          | Трудоемкость, ч | Формируемые компетенции | Формы контроля                            |
|--|--|-----------------|-------------------------|---|
| <b>1 семестр</b>                           |  |                 |                         |   |
| 1 Целостное управление рисками             | Подготовка к тестированию                            | 6               | УК-1                    | Тестирование                              |
|  | Подготовка к устному опросу / собеседованию          | 10              | УК-1                    | Устный опрос / собеседование              |
|  | Итого  | 16              |                         |   |
| 2 Риск как объект диагностики и оценки     | Подготовка к тестированию                            | 6               | УК-1                    | Тестирование                              |
|  | Подготовка к устному опросу / собеседованию          | 10              | УК-1                    | Устный опрос / собеседование              |
|  | Написание отчета по практическому занятию (семинару) | 15              | УК-1                    | Отчет по практическому занятию (семинару) |
|  | Итого  | 31              |                         |   |
| 3 Управленческий механизм риск-менеджмента | Подготовка к тестированию                            | 6               | УК-1                    | Тестирование                              |
|  | Подготовка к устному опросу / собеседованию          | 10              | УК-1                    | Устный опрос / собеседование              |
|  | Написание отчета по практическому занятию (семинару) | 15              | УК-1                    | Отчет по практическому занятию (семинару) |
|  | Итого  | 31              |                         |   |

|  |  |     |      |   |
|--|--|-----|------|---|
| 4 Человеческий аспект управления рисками | Подготовка к тестированию                            | 6   | УК-1 | Тестирование                              |
|  | Подготовка к устному опросу / собеседованию          | 10  | УК-1 | Устный опрос / собеседование              |
|  | Итого  | 16  |      |   |
| 5 Финансовый аспект управления рисками   | Подготовка к тестированию                            | 6   | УК-1 | Тестирование                              |
|  | Подготовка к устному опросу / собеседованию          | 10  | УК-1 | Устный опрос / собеседование              |
|  | Написание отчета по практическому занятию (семинару) | 15  | УК-1 | Отчет по практическому занятию (семинару) |
|  | Итого  | 31  |      |   |
| 6 Инструментальный ящик риск-менеджера   | Подготовка к тестированию                            | 6   | УК-1 | Тестирование                              |
|  | Подготовка к устному опросу / собеседованию          | 10  | УК-1 | Устный опрос / собеседование              |
|  | Написание отчета по практическому занятию (семинару) | 15  | УК-1 | Отчет по практическому занятию (семинару) |
|  | Итого  | 31  |      |   |
| Итого за семестр                         |  | 156 |      |   |
|  | Подготовка и сдача экзамена                          | 36  |      | Экзамен                                   |
| Итого                                    |  | 192 |      |   |

### **5.7. Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов учебной деятельности**

Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов учебной деятельности представлено в таблице 5.7.

Таблица 5.7 – Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

| Формируемые компетенции | Виды учебной деятельности |            |           | Формы контроля   |
|-------------------------|---------------------------|------------|-----------|--|
|                         | Лек. зан.                 | Прак. зан. | Сам. раб. |  |
| УК-1                    | +                         | +          | +         | Отчет по практическому занятию (семинару), Тестирование, Устный опрос / собеседование, Экзамен |

### **6. Рейтинговая система для оценки успеваемости обучающихся**

#### **6.1. Балльные оценки для форм контроля**

Балльные оценки для форм контроля представлены в таблице 6.1.

Таблица 6.1 – Балльные оценки

| Формы контроля                            | Максимальный балл на 1-ую КТ с начала семестра | Максимальный балл за период между 1КТ и 2КТ | Максимальный балл за период между 2КТ и на конец семестра | Всего за семестр |
|---|--|---|---|------------------|
| <b>1 семестр</b>                          |  |   |   |                  |
| Устный опрос / собеседование              | 10   | 10  | 10  | 30               |
| Тестирование                              | 5  | 5   | 5   | 15               |
| Отчет по практическому занятию (семинару) | 5  | 10  | 10  | 25               |
| Экзамен                                   |  |   |   | 30               |
| Итого максимум за период                  | 20   | 25  | 25  | 100              |
| Нарастающим итогом                        | 20   | 45  | 70  | 100              |

### 6.2. Пересчет баллов в оценки за текущий контроль

Пересчет баллов в оценки за текущий контроль представлен в таблице 6.2.

Таблица 6.2 – Пересчет баллов в оценки за текущий контроль

| Баллы на дату текущего контроля                       | Оценка |
|---|--------|
| ≥ 90% от максимальной суммы баллов на дату ТК         | 5      |
| От 70% до 89% от максимальной суммы баллов на дату ТК | 4      |
| От 60% до 69% от максимальной суммы баллов на дату ТК | 3      |
| < 60% от максимальной суммы баллов на дату ТК         | 2      |

### 6.3. Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку представлен в таблице 6.3.

Таблица 6.3 – Пересчет суммы баллов в традиционную и международную оценку

| Оценка                               | Итоговая сумма баллов, учитывает успешно сданный экзамен | Оценка (ECTS)           |
|--------------------------------------|--|-------------------------|
| 5 (отлично) (зачтено)                | 90 – 100   | A (отлично)             |
| 4 (хорошо) (зачтено)                 | 85 – 89  | B (очень хорошо)        |
|                                      | 75 – 84  | C (хорошо)              |
|                                      | 70 – 74  | D (удовлетворительно)   |
| 3 (удовлетворительно) (зачтено)      | 65 – 69  | E (посредственно)       |
|                                      | 60 – 64  |                         |
| 2 (неудовлетворительно) (не зачтено) | Ниже 60 баллов   | F (неудовлетворительно) |

## 7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### 7.1. Основная литература

1. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 365 с. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/536005>.

### 7.2. Дополнительная литература

1. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе : учебник для вузов / Т. Г. Касьяненко. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 456 с. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/554991>.



2. Управление финансовыми рисками. Практический курс : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/534353>.

3. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 569 с. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/536964>.

### **7.3. Учебно-методические пособия**

#### **7.3.1. Обязательные учебно-методические пособия**

1. Риск-менеджмент: Методические указания для практических занятий и самостоятельной работы / В. Ю. Цибулькинова - 2018. 58 с. [Электронный ресурс]: — Режим доступа: <https://edu.tusur.ru/publications/8441>.

#### **7.3.2. Учебно-методические пособия для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов**

Учебно-методические материалы для самостоятельной и аудиторной работы обучающихся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации.

**Для лиц с нарушениями зрения:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

**Для лиц с нарушениями слуха:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

**Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

### **7.4. Современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы**

1. При изучении дисциплины рекомендуется обращаться к современным базам данных, информационно-справочным и поисковым системам, к которым у ТУСУРа открыт доступ: <https://lib.tusur.ru/ru/resursy/bazy-dannyh>.

## **8. Материально-техническое и программное обеспечение дисциплины**

### **8.1. Материально-техническое и программное обеспечение для лекционных занятий**

Для проведения занятий лекционного типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации используется учебная аудитория с достаточным количеством посадочных мест для учебной группы, оборудованная доской и стандартной учебной мебелью. Имеются мультимедийное оборудование и учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации по лекционным разделам дисциплины.

### **8.2. Материально-техническое и программное обеспечение для практических занятий**

Учебная аудитория: учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, учебная аудитория для проведения занятий практического типа, учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, помещение для проведения групповых и индивидуальных консультаций, помещение для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации; 634045, Томская область, г. Томск, ул. Красноармейская, д. 146, 501 ауд.

Описание имеющегося оборудования:

- Проектор Acer X1128H;
- Проекционный экран;
- Магнитно-маркерная доска (настенная);
- Магнитно-маркерная доска (на ножках);
- Комплект специализированной учебной мебели;
- Рабочее место преподавателя.

Программное обеспечение:

- 7-Zip;
- FoxitReader;
- Google Chrome;
- Mozilla Firefox;
- OpenOffice;
- Консультант Плюс;

### **8.3. Материально-техническое и программное обеспечение для самостоятельной работы**

Для самостоятельной работы используются учебные аудитории (компьютерные классы), расположенные по адресам:

- 634050, Томская область, г. Томск, Ленина проспект, д. 40, 233 ауд.;
- 634045, Томская область, г. Томск, ул. Красноармейская, д. 146, 209 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 47, 126 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 74, 207 ауд.

Описание имеющегося оборудования:

- учебная мебель;
- компьютеры;
- компьютеры подключены к сети «Интернет» и обеспечивают доступ в электронную информационно-образовательную среду ТУСУРа.

Перечень программного обеспечения:

- Microsoft Windows;
- OpenOffice;
- Kaspersky Endpoint Security 10 для Windows;
- 7-Zip;
- Google Chrome.

### **8.4. Материально-техническое обеспечение дисциплины для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов**

Освоение дисциплины лицами с ограниченными возможностями здоровья и инвалидами осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения.

При занятиях с обучающимися с **нарушениями слуха** предусмотрено использование звукоусиливающей аппаратуры, мультимедийных средств и других технических средств приема/передачи учебной информации в доступных формах, мобильной системы преподавания для обучающихся с инвалидностью, портативной индукционной системы. Учебная аудитория, в которой занимаются обучающиеся с нарушением слуха, оборудована компьютерной техникой, аудиотехникой, видеотехникой, электронной доской, мультимедийной системой.

При занятиях с обучающимися с **нарушениями зрения** предусмотрено использование в лекционных и учебных аудиториях возможности просмотра удаленных объектов (например, текста на доске или слайда на экране) при помощи видеоувеличителей для комфортного просмотра.

При занятиях с обучающимися с **нарушениями опорно-двигательного аппарата** используются альтернативные устройства ввода информации и другие технические средства приема/передачи учебной информации в доступных формах, мобильной системы обучения для людей с инвалидностью.

## **9. Оценочные материалы и методические рекомендации по организации изучения дисциплины**

### **9.1. Содержание оценочных материалов для текущего контроля и промежуточной аттестации**

Для оценки степени сформированности и уровня освоения закрепленных за дисциплиной компетенций используются оценочные материалы, представленные в таблице 9.1.

Таблица 9.1 – Формы контроля и оценочные материалы

| Названия разделов (тем) дисциплины         | Формируемые компетенции | Формы контроля                            | Оценочные материалы (ОМ)                                       |
|--|-------------------------|---|--|
| 1 Целостное управление рисками             | УК-1                    | Устный опрос / собеседование              | Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования |
|  |                         | Тестирование                              | Примерный перечень тестовых заданий                            |
|  |                         | Экзамен                                   | Перечень экзаменационных вопросов                              |
| 2 Риск как объект диагностики и оценки     | УК-1                    | Устный опрос / собеседование              | Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования |
|  |                         | Тестирование                              | Примерный перечень тестовых заданий                            |
|  |                         | Экзамен                                   | Перечень экзаменационных вопросов                              |
|  |                         | Отчет по практическому занятию (семинару) | Темы практических занятий                                      |
| 3 Управленческий механизм риск-менеджмента | УК-1                    | Устный опрос / собеседование              | Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования |
|  |                         | Тестирование                              | Примерный перечень тестовых заданий                            |
|  |                         | Экзамен                                   | Перечень экзаменационных вопросов                              |
|  |                         | Отчет по практическому занятию (семинару) | Темы практических занятий                                      |
| 4 Человеческий аспект управления рисками   | УК-1                    | Устный опрос / собеседование              | Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования |
|  |                         | Тестирование                              | Примерный перечень тестовых заданий                            |
|  |                         | Экзамен                                   | Перечень экзаменационных вопросов                              |
| 5 Финансовый аспект управления рисками     | УК-1                    | Устный опрос / собеседование              | Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования |
|  |                         | Тестирование                              | Примерный перечень тестовых заданий                            |
|  |                         | Экзамен                                   | Перечень экзаменационных вопросов                              |
|  |                         | Отчет по практическому занятию (семинару) | Темы практических занятий                                      |

|   |      |  |  |
|---|------|--|--|
| 6 Инструментальный ящик<br>риск-менеджера | УК-1 | Устный опрос /<br>собеседование                    | Примерный перечень<br>вопросов для устного<br>опроса / собеседования |
|   |      | Тестирование                                       | Примерный перечень<br>тестовых заданий                               |
|   |      | Экзамен  | Перечень экзаменационных<br>вопросов                                 |
|   |      | Отчет по<br>практическому<br>занятию<br>(семинару) | Темы практических занятий  |

Шкала оценки сформированности отдельных планируемых результатов обучения по дисциплине приведена в таблице 9.2.

Таблица 9.2 – Шкала оценки сформированности планируемых результатов обучения по дисциплине

| Оценка                     | Баллы за ОМ   | Формулировка требований к степени сформированности<br>планируемых результатов обучения |   |  |
|----------------------------|---|--|---|--|
|                            |   | знать  | уметь   | владеть  |
| 2<br>(неудовлетворительно) | < 60% от<br>максимальной<br>суммы баллов            | отсутствие знаний<br>или фрагментарные<br>знания                                       | отсутствие<br>умений или<br>частично<br>освоенное<br>умение             | отсутствие<br>навыков или<br>фрагментарные<br>применение<br>навыков                    |
| 3<br>(удовлетворительно)   | от 60% до<br>69% от<br>максимальной<br>суммы баллов | общие, но не<br>структурированные<br>знания  | в целом успешно,<br>но не<br>систематически<br>осуществляемое<br>умение | в целом<br>успешное, но не<br>систематическое<br>применение<br>навыков                 |
| 4 (хорошо)                 | от 70% до<br>89% от<br>максимальной<br>суммы баллов | сформированные,<br>но содержащие<br>отдельные<br>проблемы знания                       | в целом<br>успешное, но<br>содержащие<br>отдельные<br>пробелы умение    | в целом<br>успешное, но<br>содержащие<br>отдельные<br>пробелы<br>применение<br>навыков |
| 5 (отлично)                | ≥ 90% от<br>максимальной<br>суммы баллов            | сформированные<br>систематические<br>знания  | сформированное<br>умение  | успешное и<br>систематическое<br>применение<br>навыков                                 |

Шкала комплексной оценки сформированности компетенций приведена в таблице 9.3.

Таблица 9.3 – Шкала комплексной оценки сформированности компетенций

| Оценка                     | Формулировка требований к степени компетенции   |
|----------------------------|---|
| 2<br>(неудовлетворительно) | Не имеет необходимых представлений о проверяемом материале<br>или<br>Знать на уровне <b>ориентирования</b> , представлений. Обучающийся знает основные признаки или термины изучаемого элемента содержания, их отнесенность к определенной науке, отрасли или объектам, узнает в текстах, изображениях или схемах и знает, к каким источникам нужно обращаться для более детального его усвоения. |

|                          |  |
|--------------------------|--|
| 3<br>(удовлетворительно) | Знать и уметь на <b>репродуктивном</b> уровне. Обучающихся знает изученный элемент содержания репродуктивно: произвольно воспроизводит свои знания устно, письменно или в демонстрируемых действиях.   |
| 4 (хорошо)               | Знать, уметь, владеть на <b>аналитическом</b> уровне. Зная на репродуктивном уровне, указывать на особенности и взаимосвязи изученных объектов, на их достоинства, ограничения, историю и перспективы развития и особенности для разных объектов усвоения.   |
| 5 (отлично)              | Знать, уметь, владеть на <b>системном</b> уровне. Обучающийся знает изученный элемент содержания системно, произвольно и доказательно воспроизводит свои знания устно, письменно или в демонстрируемых действиях, учитывая и указывая связи и зависимости между этим элементом и другими элементами содержания дисциплины, его значимость в содержании дисциплины. |

### 9.1.1. Примерный перечень тестовых заданий

1. Риск – это...
  - 1) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели;
  - 2) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна;
  - 3) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера;
  - 4) все выше перечисленное.
2. Отметьте потери, которые можно отнести к трудовым:
  - 1) потери рабочего времени;
  - 2) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию;
  - 3) уплата дополнительных налогов;
  - 4) невыполнение сроков сдачи объекта.
3. Анализ риска – это...
  - 1) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия;
  - 2) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты;
  - 3) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик;
  - 4) нет верного ответа.
4. Идентификация риска – это...
  - 1) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия;
  - 2) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик;
  - 3) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты;
  - 4) нет верного ответа.
5. Стратегические риски для быстро растущих компаний:
  - 1) запаздывание в адаптации своих компетенций;
  - 2) концентрация усилий на среднесрочных и долгосрочных стратегических инициативах;
  - 3) попытка гарантировать конкурентное преимущество в сферах бизнеса и товарных группах будущего;
  - 4) попытки компании достичь преимущества одновременно по издержкам, за счет дифференциации и на основе сфокусированной стратегии.

6. Систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия называется:
  - 1) идентификацией рисков;
  - 2) анализом рисков;
  - 3) классификацией рисков;
  - 4) планированием рисков.
7. Какой из перечисленных методов оценки риска основан на расчетах и анализе статистических показателей?
  - 1) вероятностный метод;
  - 2) построение дерева решений;
  - 3) метод сценариев;
  - 4) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости.
8. Какой из перечисленных методов оценки риска дает представление о наиболее критических факторах инвестиционного проекта?
  - 1) построение дерева решений;
  - 2) метод сценариев;
  - 3) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;
  - 4) анализ чувствительности.
9. Какой из перечисленных методов оценки риска реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков?
  - 1) построение дерева решений;
  - 2) метод сценариев;
  - 3) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;
  - 4) анализ чувствительности.
10. Какой из перечисленных методов оценки риска используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий?
  - 1) вероятностный метод;
  - 2) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;
  - 3) построение дерева решений;
  - 4) метод сценариев.

### **9.1.2. Перечень экзаменационных вопросов**

1. Понятие риска и неопределенности.
2. Общая характеристика хозяйственных рисков, их классификация.
3. Концепции управления рисками.
4. Стратегия управления рисками.
5. Сущность риск-менеджмента, его цели и задачи.
6. Объекты и субъекты риск-менеджмента.
7. Принципы риск-менеджмента.
8. Содержание политики управления финансовыми рисками.
9. Методы управления финансовыми рисками.
10. Методы оценки финансовых рисков.

### **9.1.3. Примерный перечень вопросов для устного опроса / собеседования**

1. Понятие и сущность риска.
2. Определение, функции, организация и правила управление рисками.
3. Информационное обеспечение управления рисками.
4. Классификация рисков.
5. Анализ и оценка степени риска.
6. Управление рисками, возникающими при инвестировании.
7. Риск-менеджмент.
8. Хеджирование рисков.
9. Анализ риска в инвестиционной программе.
10. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций.
11. Рациональный выбор инвестиционного портфеля.

### 9.1.4. Темы практических занятий

1. Основы оценки риска: использование финансовых и статистических показателей
2. Анализ и оценка степени риска. Оценка риска предпринимательского проекта на основе анализа безубыточности
3. Анализ системы управления рисками в организации
4. Комплексная оценка рисков проекта с учетом внешнеэкономических факторов

### 9.2. Методические рекомендации

Учебный материал излагается в форме, предполагающей самостоятельное мышление студентов, самообразование. При этом самостоятельная работа студентов играет решающую роль в ходе всего учебного процесса.

Начать изучение дисциплины необходимо со знакомства с рабочей программой, списком учебно-методического и программного обеспечения. Самостоятельная работа студента включает работу с учебными материалами, выполнение контрольных мероприятий, предусмотренных учебным планом.

В процессе изучения дисциплины для лучшего освоения материала необходимо регулярно обращаться к рекомендуемой литературе и источникам, указанным в учебных материалах; пользоваться через кабинет студента на сайте Университета образовательными ресурсами электронно-библиотечной системы, а также общедоступными интернет-порталами, содержащими научно-популярные и специализированные материалы, посвященные различным аспектам учебной дисциплины.

При самостоятельном изучении тем следуйте рекомендациям:

– чтение или просмотр материала осуществляйте со скоростью, достаточной для индивидуального понимания и освоения материала, выделяя основные идеи; на основании изученного составить тезисы. Освоив материал, попытаться соотнести теорию с примерами из практики;

– если в тексте встречаются незнакомые или малознакомые термины, следует выяснить их значение для понимания дальнейшего материала;

– осмысливайте прочитанное и изученное, отвечайте на предложенные вопросы.

Студенты могут получать индивидуальные консультации, в т.ч. с использованием средств телекоммуникации.

По дисциплине могут проводиться дополнительные занятия, в т.ч. в форме вебинаров. Расписание вебинаров и записи вебинаров публикуются в электронном курсе / электронном журнале по дисциплине.

### 9.3. Требования к оценочным материалам для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предусмотрены дополнительные оценочные материалы, перечень которых указан в таблице 9.4.

Таблица 9.4 – Дополнительные материалы оценивания для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

| Категории обучающихся                       | Виды дополнительных оценочных материалов  | Формы контроля и оценки результатов обучения    |
|---|---|---|
| С нарушениями слуха                         | Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы                        | Преимущественно письменная проверка             |
| С нарушениями зрения                        | Собеседование по вопросам к зачету, опрос по терминам   | Преимущественно устная проверка (индивидуально) |
| С нарушениями опорно-двигательного аппарата | Решение дистанционных тестов, контрольные работы, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету | Преимущественно дистанционными методами         |

|   |  |  |
|---|--|--|
| С ограничениями по<br>общемедицинским<br>показаниям | Тесты, письменные<br>самостоятельные работы, вопросы<br>к зачету, контрольные работы,<br>устные ответы | Преимущественно проверка<br>методами, определяющимися<br>исходя из состояния<br>обучающегося на момент<br>проверки |
|---|--|--|

#### **9.4. Методические рекомендации по оценочным материалам для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов**

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предусматривается доступная форма предоставления заданий оценочных средств, а именно:

- в печатной форме;
- в печатной форме с увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа;
- методом чтения ассистентом задания вслух;
- предоставление задания с использованием сурдоперевода.

Лицам с ограниченными возможностями здоровья и инвалидам увеличивается время на подготовку ответов на контрольные вопросы. Для таких обучающихся предусматривается доступная форма предоставления ответов на задания, а именно:

- письменно на бумаге;
- набор ответов на компьютере;
- набор ответов с использованием услуг ассистента;
- представление ответов устно.

Процедура оценивания результатов обучения лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

**Для лиц с нарушениями зрения:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме увеличенным шрифтом.

**Для лиц с нарушениями слуха:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

**Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:**

- в форме электронного документа;
- в печатной форме.

При необходимости для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения может проводиться в несколько этапов.



## ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЯ

Рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Менеджмента  
протокол № 11 от «23» 11 2023 г.

### СОГЛАСОВАНО:

| Должность                                  | Инициалы, фамилия | Подпись  |
|--|-------------------|--|
| Заведующий выпускающей каф. Менеджмента    | М.А. Афонасова    | Согласовано,<br>b62b44b3-4a58-4b2a-<br>82c7-683ac1767431 |
| Заведующий обеспечивающей каф. Менеджмента | М.А. Афонасова    | Согласовано,<br>b62b44b3-4a58-4b2a-<br>82c7-683ac1767431 |
| Начальник учебного управления              | И.А. Лариошина    | Согласовано,<br>c3195437-a02f-4972-<br>a7c6-ab6ee1f21e73 |

### ЭКСПЕРТЫ:

|                             |                |  |
|-----------------------------|----------------|--|
| Профессор, каф. менеджмента | М.А. Афонасова | Согласовано,<br>b62b44b3-4a58-4b2a-<br>82c7-683ac1767431 |
| Доцент, каф. менеджмента    | Т.А. Рябчикова | Согласовано,<br>1e8cc3ad-2b4e-43fc-<br>91f9-b97f6b86afb5 |

### РАЗРАБОТАНО:

|   |               |  |
|---|---------------|--|
| Старший преподаватель, каф. менеджмента | С.В. Бочанова | Разработано,<br>5aa11b86-761b-4c0a-<br>8299-5c6566ddeb9d |
|---|---------------|--|