

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Шамсутдинов Расим Адегамович

Должность: Директор ЛФ КНИТУ-КАИ

Дата подписания: 12.09.2022 10:29:44

Уникальный программный ключ:

d31c25eab5d6b1b0c5f8e97c64f6f09372c0857e897a4d829663982c651114

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования «Казанский национальный исследовательский
технический университет им. А.Н. Туполева-КАИ»
Лениногорский филиал
Кафедра Экономики и менеджмента

УТВЕРЖДАЮ
Директор ЛФ КНИТУ-КАИ
Р.А. Шамсутдинов
09 2017г.
Регистрационный номер 0428.09/17-39



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины (модуля)

Управление рисками

Индекс по учебному плану: **Б1.В.13**

Направление подготовки: **38.03.01 Экономика**

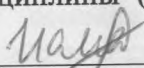
Квалификация: **бакалавр**

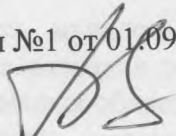
Направленность (профиль) программы: **Экономика предприятий и организаций**

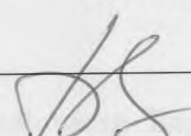
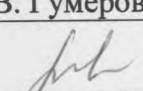
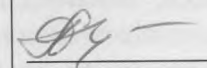
Вид(ы) профессиональной деятельности: **расчетно-экономическая, организационно-управленческая**

Лениногорск 2017 г.

Рабочая программа составлена на основе требований Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата), утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12 ноября 2015г. №1327 и в соответствии с рабочим учебным планом направления 38.03.01, утвержденным Ученым советом КНИТУ-КАИ «31» августа 2017г., протокол №6.

Рабочая программа дисциплины (модуля) разработана доцентом кафедры ЭиМ к.экон.н. Исмагиловым Р.Х. ,
(подпись преподавателя)

утверждена на заседании кафедры ЭиМ протокол №1 от 01.09.2017г.
Заведующий кафедрой проф, д.э.н. Гумеров А.В. 

Рабочая программа дисциплины:	Наименование подразделения	Дата	№ протокола	подпись
СОГЛАСОВАНА	на заседании кафедры ЭиМ	01.09.2017	№1	 Зав.кафедрой А.В. Гумеров
ОДОБРЕНА	Учебно-методическая комиссия ЛФ КНИТУ-КАИ	01.09.2017	№2	 Председатель УМК З.И. Аскарова
СОГЛАСОВАНА	Научно-техническая библиотека	01.09.2017		 Библиотекарь А.Г. Страшнова

РАЗДЕЛ 1. ИСХОДНЫЕ ДАННЫЕ И КОНЕЧНЫЙ РЕЗУЛЬТАТ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Цели изучения дисциплины (модуля)

Основной целью изучения дисциплины является формирование у будущих бакалавров системы знаний о современной концепции управления рисками в организациях, которые позволят им принимать эффективные управленческие решения, а также заложить потенциал знаний, определяющих профессионализм деятельности экономиста.

1.2. Задачи дисциплины (модуля)

Основными задачами изучения дисциплины являются:

- обучить студентов основным тенденциям развития риск-менеджмента в современных условиях; теоретическим основам управления рисками, позволяющим им овладеть современными инструментами и технологиями управления рисками, комплексным подходом к рассмотрению проблем антикризисного стратегического управления организацией и принятию эффективных управленческих решений;
- развить у студентов самостоятельность мышления при разработке концепции формирования и антикризисного стратегического развития организации, творческий подход при анализе и оценке конкретных ситуаций в различных областях деятельности организации;
- способствовать приобретению практических навыков в области выявления новых возможностей и соответствующих им рисков в деятельности организации, их комплексного анализа и оценки, эффективного управления рисками организации.

1.3. Место дисциплины (модуля) в структуре ОП ВО

Дисциплина «Управление рисками» входит в состав вариативной части Блока 1 Дисциплины (модули).

Логическая и содержательная связь дисциплин, участвующих в формировании представленных в п.1.5 компетенций:

Компетенция: ПК-1

Предшествующие дисциплины: Машиностроительные технологии, Экономический анализ предприятий, Организация научно-исследовательских работ, Макроэкономическое планирование и прогнозирование, Математические методы в исследовании экономики, Методы проведения экономических исследований, Основы внешнеэкономической деятельности предприятия, Экономика, торговая политика и право ВТО, таможенного союза и зоны свободной торговли стран СНГ, Производственная технологическая практика, Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности

Последующие дисциплины: Преддипломная практика, Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты

Компетенция: ПК-11

Предшествующие дисциплины: Теория отраслевых рынков, Методы и инструменты бережливого производства, Управление операциями, Основы внешнеэкономической деятельности предприятия, Экономика, торговая политика и право ВТО, таможенного союза и зоны свободной торговли стран СНГ, Управление персоналом, Теория лидерства, Современные социально-политические проблемы, Социально-экономические проблемы современности, Производственная технологическая практика, Производственная практика по получению профессиональных умений и опыта профессиональной деятельности

Дисциплины, изучаемые одновременно: Экономика качества, Организация инновационной деятельности предприятия (организации), Планирование на предприятии, Производственное планирование

Последующие дисциплины: Преддипломная практика, Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты

1.4 Объем дисциплины (модуля) (с указанием трудоемкости всех видов учебной работы)

Таблица 1а

Объем дисциплины (модуля) для очной формы обучения

Виды учебной работы	Общая трудоемкость		Семестр:	
	в ЗЕ	в час	8	
			в ЗЕ	в час
Общая трудоемкость дисциплины (модуля)	3	108	3	108
<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем (аудиторные занятия)</i>	<i>1</i>	<i>36</i>	<i>1</i>	<i>36</i>
Лекции	0,5	18	0,5	18
Лабораторные работы	не предусмотрены			
Практические занятия	0,5	18	0,5	18
<i>Самостоятельная работа студента</i>	<i>1</i>	<i>36</i>	<i>1</i>	<i>36</i>
Проработка учебного материала	1	36	1	36
Курсовой проект	не предусмотрено			
Курсовая работа	не предусмотрено			
Подготовка к промежуточной аттестации	1	36	1	36
Промежуточная аттестация:	экзамен			

Таблица 1б

Объем дисциплины (модуля) для заочной формы обучения

Виды учебной работы	Общая трудоемкость		Семестр	
	в ЗЕ	в час	8	
			в ЗЕ	в час
Общая трудоемкость дисциплины (модуля)	3	108	3	108
<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем (аудиторные занятия)</i>	<i>0,4</i>	<i>16</i>	<i>0,4</i>	<i>16</i>
Лекции	0,2	6	0,2	6
Лабораторные работы	не предусмотрены			
Практические занятия	0,3	10	0,3	10
<i>Самостоятельная работа студента</i>	<i>2,3</i>	<i>83</i>	<i>2,3</i>	<i>83</i>
Проработка учебного материала	2,3	83	2,3	83
Курсовой проект	не предусмотрено			
Курсовая работа	не предусмотрено			
Подготовка к промежуточной аттестации	0,3	9	0,3	9
Промежуточная аттестация:	экзамен			

1.5 Планируемые результаты обучения

Таблица 2

Формируемые компетенции

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)	Уровни освоения составляющих компетенций		
	Пороговый	Продвинутый	Превосходный
ПК-1 – способность собирать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов			

Знание (ПК-13) источников исходных данных для оценки рисков	Знание источников исходных данных для оценки рисков	Знание классификации источников исходных данных для оценки рисков	Знание классификации и методов сбора источников исходных данных для оценки рисков
Умение (ПК-1У) компетентно представлять обоснование управленческих решений с учетом рисков	Умение компетентно представлять обоснование управленческих решений с учетом рисков	Умение компетентно представлять обоснование управленческих решений с учетом рисков, выявлять существующие проблемы	Умение компетентно представлять обоснование управленческих решений с учетом рисков, выявлять существующие проблемы и предлагать направления их решения
Владение (ПК-1В) методами анализа рисков	Владение методами анализа рисков	Владение навыками вариативного использования методов анализа рисков	Владение навыками определения ситуационных особенностей использования методов анализа рисков
ПК – 11 – способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий.			
Знание (ПК-11З) математического аппарата анализа рисков	Знание базового математического аппарата анализа рисков	Знание основного математического аппарата анализа рисков	Знание математических методов анализа рисков
Умение (ПК-11У) представлять результаты оценки рисков	Умение представлять результаты оценки рисков	Умение представлять и интерпретировать результаты оценки рисков	Умение представлять результаты оценки рисков и давать рекомендации по осуществлению предпринимательской деятельности
Владение (ПК-11В) методами оценки рисков	Владение методами оценки рисков	Адаптация методов оценки рисков к конкретной ситуации	Владение методами оценки рисков в сложных ситуациях

РАЗДЕЛ 2 СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) И ТЕХНОЛОГИЯ ЕЕ ОСВОЕНИЯ

2.1. Структура дисциплины (модуля), ее трудоемкость

Таблица 3а

Распределение фонда времени по видам занятий

Очная форма

Наименование раздела и темы	Всего часов	Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Коды компетенций	Формы и вид контроля освоения составляющих компетенций (из фонда оценочных средств)
		лекции	лаб. раб.	пр. зан.	сам. раб.		
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками							ФОС ТК-1
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	8	2		2	4	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 1.2. Классификация рисков. Признаки классификации рисков.	15	4		4	7	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 1.3. Принципы оценки рисков. Методы оценки рисков.	15	4		4	7	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Раздел 2. Методические и практические инструменты управления рисками							ФОС ТК-2
Тема 2.1. Методы управления рисками	11	2		2	7	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 2.2. Страхование как метод управления рисками. Оптимизация бюджета капиталовложений с учетом риска.	15	4		4	7	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Раздел 3. Управление рискам в проектной деятельности							ФОС ТК-3
Тема 3.1. Оценка проекта с учетом риска. Финансирование рисков. Информационное обеспечение риск-менеджмента.	8	2		2	4	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
ЭКЗАМЕН	36					ПК -1, ПК -11	ФОС ПА
Итого	108	18		18	36		

Таблица 3б

Распределение фонда времени по видам занятий

Заочная форма

Наименование раздела и темы	Всего часов	Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Коды компетенций	Формы и вид контроля освоения составляющих компетенций (из фонда оценочных средств)
		лекции	лаб. раб.	пр. зан.	сам. раб.		
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками							ФОС ТК-1
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	15	1		1	13	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 1.2. Классификация рисков. Признаки классификации рисков.	16	1		2	13	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 1.3. Принципы оценки	16	1		2	13	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль

рисков. Методы оценки рисков.							
Раздел 2. Методические и практические инструменты управления рисками							<i>ФОС ТК-2</i>
Тема 2.1. Методы управления рисками	15	1		1	13	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 2.2. Страхование как метод управления рисками. Оптимизация бюджета капиталовложений с учетом риска.	16	1		2	13	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Раздел 3. Управление рискам в проектной деятельности							<i>ФОС ТК-3</i>
Тема 3.1. Оценка проекта с учетом риска. Финансирование рисков. Информационное обеспечение риск-менеджмента.	21	1		2	18	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
ЭКЗАМЕН	9					ПК -1, ПК -11	<i>ФОС ПА</i>
Итого	108	6		10	83		

Таблица 4

Матрица компетенций по разделам РП

Наименование раздела (тема)	Формируемые компетенции (составляющие компетенций)					
	ПК-I			ПК-II		
	ПК-13	ПК-1У	ПК-1В	ПК-113	ПК-11У	ПК-11В
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками						
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	+			+		
Тема 1.2. Классификация рисков. Признаки классификации рисков.	+	+			+	+
Тема 1.3. Принципы оценки рисков. Методы оценки рисков.		+	+	+	+	+
Раздел 2. Методические и практические инструменты управления рисками						
Тема 2.1. Методы управления рисками	+	+	+		+	+
Тема 2.2. Страхование как метод управления рисками. Оптимизация бюджета капиталовложений с учетом риска.	+	+	+	+	+	+
Раздел 3. Управление рискам в проектной деятельности						
Тема 3.1. Оценка проекта с учетом риска. Финансирование рисков. Информационное обеспечение риск-менеджмента.	+	+	+	+	+	+

2.2 Содержание дисциплины (модуля)

Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками.

Тема 1.1. Предмет и содержание курса.

Понятие риска. Бизнес и риск. Неопределенность, вероятность и риск. Причины неопределенности. Факторы риска. Функции риска. Объекты и субъекты риска. Связь риска и прибыли предприятия. Цели и задачи риск-менеджмента.

Литература: [1, 2, 3].

Тема 1.2. Классификация рисков. Признаки классификации рисков

Классификация рисков. Признаки классификации рисков. Подходы к выявлению рисков. Параметры рисков – вероятность, ущерб, длительность воздействия. Стандарты риск-менеджмента. Стандарт АНСИ. Стандарт Ферма. Стандарт Американской ассоциации риск-менеджмента. Модель COSO.

Литература: [1, 2, 3].

Тема 1.3. Принципы оценки рисков. Методы оценки рисков.

Принципы оценки рисков. Сущность оценки риска. Содержание оценки риска. Принципы оценки риска. Задачи оценки рисков. Качественный и количественный анализ риска. Методы оценки рисков. Метод анализа чувствительности. Сценарный подход. Метод дерева отказов. Метод дерева решений. Метод дерева вероятностей.

Литература: [1, 2, 3].

Раздел 2. Методические и практические инструменты управления рисками

Тема 2.1. Методы управления рисками.

Классификация методов управления рисками. Признаки классификации методов управления рисками. Система принципов принятия решений в рамках проекта в условиях риска. Схема Квинтилиана для сужения проблемы. локализации рисков. Диссипация рисков. Компенсация рисков. Уклонение от рисков. Поглощение рисков.

Литература: [1,2,3]

Тема 2.2. Страхование как метод управления рисками. Оптимизация бюджета капиталовложений с учетом риска.

Суть страхования как метода управления рисками. Виды и объекты страхования. Условия страхуемости рисков. Достоинства и недостатки страхования как метода управления риска. Оптимизация бюджета капиталовложений с учетом риска. Методы формирования бюджета капиталовложений. Оптимизация бюджета капиталовложений с учетом риска упущенной выгоды. Недопущение риска снижения прибыли инвестиций. Приоритетность проектов и уровень бюджета инвестиций.

Литература: [1, 2, 3]

Раздел 3. Управление рискам в проектной деятельности

Тема 3.1. Оценка проекта с учетом риска. Финансирование рисков. Информационное обеспечение риск-менеджмента.

Суть оценки эффективности проектов. Критерии оценки влияния рисков. Ущерб для проекта. Карта рисков проекта. Финансирование рисков. Методы и модели финансирования мер снижения проектных рисков. Достоинства и недостатки применения отдельных методов финансирования риска. Информационное обеспечение риск - менеджмента. Источники информации о рисках предприятия и проекта. Принципы информационного обеспечения риск-менеджмента. Требования к информации. Методы обработки информации о рисках.

Литература: [1, 2, 3]

2.3 Курсовой проект/ курсовая работа

Курсовая работа по дисциплине «Управление рисками» в соответствии с учебным планом не предусмотрена.

РАЗДЕЛ 3 ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) И КРИТЕРИИ ОЦЕНОК ОСВОЕНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

3.1 Оценочные средства для текущего контроля

Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля (ФОС ТК) является составной частью РП дисциплины (модуля) и хранится на кафедре.

Фонд оценочных средств текущего контроля

№ п/п	Наименование раздела (модуля)	Вид оценочных средств	Примечание
1	2	3	4
1.	Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками.	ФОС ТК-1	Тест текущего контроля дисциплины по первому разделу (ФОС ТК-1). Выполнение индивидуальных заданий
2.	Раздел 2. Методические и практические инструменты управления рисками	ФОС ТК-2	Тест текущего контроля дисциплины по второму разделу (ФОС ТК-2). Выполнение индивидуальных заданий
3.	Раздел 3. Управление рискам в проектной деятельности	ФОС ТК-3	Практическая работа (ФОС ТК-3)

Типовые оценочные средства для текущего контроля:

Пример теста

1. Что вы понимаете под термином риск?

- а) опасность возникновения финансовых преград, в результате которых возможно несение ущерба предприятием;
- б) деятельность, связанная с преодолением неопределенности в ситуации неизбежного выбора, в процессе которой имеется возможность количественно и качественно оценить вероятность достижения предполагаемого результата, неудачи и отклонения от цели;
- в) возникновение неопределенности в результате внешнего воздействия на проект при неверных управленческих решениях.

2. Работая в условиях полной неопределенности на каких критериях основывается принятие решений?

- а) критерий оптимиста, критерий пессимиста;
- б) критерий гарантированного результата, критерий обобщенного максимина; критерий минимаксного риска;
- в) критерий минимального риска, критерий ликвидации опасности, критерий положительного исхода;
- г) все выше перечисленное.

3. В чем заключается сущность критерия Вальда?

- а) у объекта минимальный процент благоприятного исхода из сложившейся рискованной ситуации;
- б) субъект решения располагает множеством вариантов решения проблемы;
- в) субъект должен располагать значительным финансовым потенциалом для решения сложившейся проблемы управления риском;
- г) субъект заведомо приговорен к банкротству, если критерий Вальда конкретного предприятия меньше 1.

4. При использовании критерия Сэвиджа на основе чего принимается решение?

- а) решение принимается на основе матрицы эффективности;
- б) решение принимается на основе раннее рассчитанных критериев оптимиста и пессимиста;
- в) решение принимается на основе матрицы рисков.

5. В чем заключается задача проведения качественного анализа рисков?

- а) оценка условий возникновения рисков;
- б) определение воздействия рисков на проект;

- в) выявление рисков;
- г) все выше перечисленное.

Вопросы для самостоятельной работе

Классификация рисков.
Неформализуемые методы управления риском.
Методы оценки риска.
Имитационное моделирование.
Диверсификация как метод управления рисками.
Особенности хеджирования и страхования рисков.
Принципы построения дерева решений.
Диссипация рисков.
Методы управления рисками.
Качественный и количественный анализ рисков.
Экспертный метод оценки рисков.
Алгоритм принятия решений в условиях риска.
Страхование рисков.
Алгоритм принятия решений в условиях полной неопределенности.
Методы поглощения рисков.
Методы уклонения от рисков.
Методы компенсации рисков.

Индивидуальные задания для практических занятий

Выявить и классифицировать риски, которые воздействуют на объект риска.
Провести оценку рисков по следующим критериям:

- существенность;
- значимость;
- время воздействия.

Построить карту рисков по критериям существенности и значимости.
Выявить ценности субъекта принятия решения и показать, какие риски действуют на них.

Ценности:

1. Здоровье;
2. Время;
3. Финансы;
4. Взаимоотношения с окружающими людьми;
5. Репутация;
6. Имущество.

Предложите свои методы борьбы с возникающими рисками

3.2 Оценочные средства для промежуточного контроля.

Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации (ФОС ПА) является составной частью РП дисциплины, разработан в виде отдельного документа, в соответствии с положением о ФОС ПА.

Первый этап: типовые тестовые задания

Что вы понимаете под термином неопределенность?

- +а) когда вероятность наступления таких событий оценить заранее невозможно;
- б) потеря времени в результате неверных управленческих решений;
- в) когда нет уверенности в результате.

Что вы понимаете под термином риск?

- А) опасность возникновения финансовых преград, в результате которых возможно несение ущерба предприятием;
- +Б) деятельность, связанная с преодолением неопределенности в ситуации неизбежного

выбора, в процессе которой имеется возможность количественно и качественно оценить вероятность достижения предполагаемого результата, неудачи и отклонения от цели;
в) возникновение неопределенности в результате внешнего воздействия на проект при неверных управленческих решениях.

Работая в условиях полной неопределенности на каких критериях основывается принятие решений?

+А) критерий оптимиста, критерий пессимиста;

+Б) критерий гарантированного результата, критерий обобщенного максимина; критерий минимаксного риска;

В) критерий минимального риска, критерий ликвидации опасности, критерий положительного исхода;

Г) все выше перечисленное.

Для чего необходимо учитывать следующие критерии: критерий Вальда, критерий Сэвиджа, критерий Гурвица?

А) данные критерии необходимы для осуществления аналитических вычислений;

+Б) на данных критериях основывается принятие управленческих решений в условиях неопределенности;

В) они возникают при наступлении риска.

В чем заключается сущность критерия Вальда?

А) у объекта минимальный процент благоприятного исхода из сложившейся рискованной ситуации;

+Б) субъект решения располагает множеством вариантов решения проблемы;

В) субъект должен располагать значительным финансовым потенциалом для решения сложившейся проблемы управления риском;

Г) субъект заведомо приговорен к банкротству, если критерий Вальда конкретного предприятия меньше 1.

Выберете другой вариант названия критерия Вальда?

А) критерий упущенной возможности;

Б) критерий прибыльности;

+В) критерий гарантированного результата.

Второй этап: вопросы к комплексному заданию

Теоретические навыки:

Факторы риска и виды риска.

Неформализуемые методы управления риском.

Классификация методов оценки риска.

Виды платы за применение определенного метода снижения риска.

Методы оценки риска.

Цели и задачи информационных технологий в управлении риском.

Имитационное моделирование.

Диверсификация как метод управления рисками.

Особенности хеджирования и страхования рисков.

Принципы построения дерева решений.

Диссипация рисков.

Классификация методов управления рисками.

Качественный и количественный анализ рисков.

Опцион как метод управления рисками.

Экспертный метод оценки рисков.

Алгоритм принятия решений в условиях риска.

Практические навыки: решение задачи из билета

1. Определить, в какой инвестиционный проект (с позиции рискованности) выгоднее вложить денежные средства: в проект А или в проект Б? Построить кривую риска по проекту А и Б. Определить среднее ожидаемое значение прибыли от вложения в проекты

А и Б; дисперсию по проектам А и Б; среднее квадратическое отклонение по проектам А и Б; коэффициент вариации по проекту А и по проекту Б.

Возможные значения конъюнктуры инвести-ционного рынка	Инвестиционный проект А		Инвестиционный проект Б	
	Расчетный доход, тыс.р., х	Значение вероятности, Р	Расчетный доход, тыс.р., х	Значение вероятнос ти, Р
Высокая	600	0,25	800	0,2
Средняя	500	0,5	450	0,6
Низкая	200	0,05	100	0,2
В целом	-	1	-	1

2. При вложении капитала в мероприятие А из 120 случаев прибыль в 25 тыс. р. может быть получена в 48 случаях; 20 тыс. р. в 36 случаях; 30 тыс. р. в 36 случаях. При вложении капитала в мероприятие Б из 100 случаев прибыль в 40 тыс. р. может быть получена в 30 случаях; 30 тыс. р. в 50 случаях; 15 тыс. р. в 20 случаях. Определить среднее ожидаемое значение прибыли от вложения в мероприятие А и в мероприятие Б; дисперсию по мероприятию А и по мероприятию Б; среднее квадратическое отклонение по мероприятию А и по мероприятию Б; коэффициент вариации по мероприятию А и по мероприятию Б.

Определить, в какое мероприятие выгоднее вкладывать денежные средства: в мероприятие А или в мероприятие Б?

3.3 Форма и организация промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

По итогам освоения дисциплины проведение экзамена проводится в виде: **письменного задания.**

Тестирование проводится тремя разделами.

Тестирование ставит целью оценить **пороговый** уровень освоения обучающимися заданных результатов, а также знаний и умений, предусмотренных компетенциями.

Для оценки **превосходного и продвинутого** уровня усвоения компетенций проводится **экзамен** в виде **письменного задания**, в которое входят вопросы для оценки теоретических навыков и решение задачи.

3.4 Критерии оценки промежуточной аттестации

Таблица 5

Система оценки промежуточной аттестации

Описание оценки в требованиях к уровню и объему компетенций	Выражение в баллах	Словесное выражение
Освоен превосходный уровень усвоения компетенций	от 86 до 100	отлично
Освоен продвинутый уровень усвоения компетенций	от 71 до 85	хорошо
Освоен пороговый уровень усвоения компетенций	от 51 до 70	удовлетворительно
Не освоен пороговый уровень усвоения компетенций	до 51	неудовлетворительно

РАЗДЕЛ 4 ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

4.1 Учебно-методическое обеспечение дисциплины (модуля)

4.1.1 Основная литература

1. Дараган А.В., Самышева Е.Ю. Статистические методы управления рисками предприятия: учебное пособие. – Казань: Изд-во Казан. гос. техн. ун-та, 2014. -150 с.
2. Управление рисками предприятия. [Электронный ресурс]: учебное пособие / Уродовских В.Н. - М.:Вузовский учебник, ИНФРА-М Издательский Дом, 2017. - 168 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=615086>
3. Управление рисками организации. [Электронный ресурс]: учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 153 с. - (Высшее образование: Бакалавриат – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=475625>

4.1.2. Дополнительная литература

4. Тэпман Л.Н. Риски в экономике: учебное пособие. - М: ЮНИТИ-И-ДАНА, 2004.- 380 с. - рек. УМЦ
5. Управление рисками в инновационной деятельности. [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / Грачева М.В., Ляпина С.Ю. - М.:ЮНИТИ-ДАНА, 2015. - 351 с- Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=883754>
6. Шапкин А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 6-е изд. - М.: Дашков и К, 2014. - 880 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=450763>

4.1.3. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

7. Евдокимов АА Введение в теорию риска: учебно-методическое пособие.- СПб: Санкт-Петербургский национальный исследовательский университет информационных технологий, механики и оптики, 2015. 39 с.- URL: <https://e.lanbook.com/reader/book/91505/#1>
8. Богомолов В.А. Антикризисное управление экономики. Теория и практика: учебное пособие. - М: ЮНИТИ-ДАНА, 2003. - 371 с. - рек. УМО
9. Управление рисками. [Электронный ресурс в системе Blackboard] https://bb.kai.ru:8443/webapps/blackboard/content/listContentEditable.jsp?content_id= 246477 1&course_id= 9313 1&mode=reset

4.1.4 Методические рекомендации для студентов, в том числе по выполнению самостоятельной работы

Успешное освоение материала студентами обеспечивается посещением лекций и практических занятий, написанием конспекта по темам самостоятельной работы. Прочтение будущей лекции по электронному конспекту лекций, ознакомление с будущей темой практических занятий. Работа студента при проведении расчетов будет способствовать освоению практических навыков по дисциплине.

4.1.5 Методические рекомендации для преподавателей

Успешное освоение материала обеспечивается тесной связью теоретического материала, преподносимого на лекциях и теоретико-экспериментальной работой студентов на практических занятиях. Цели обучения дисциплине могут быть достигнуты путем гармоничного сочетания лекций, практических работ и различных форм контроля усвоения знаний. Лекция должна быть содержательной, интересной для слушателей, ее содержание не должно повторять содержание учебников. Темп лекции должен быть размеренным. В ходе изложения лекционного материала преподавателю очень важно уметь активизировать работу студентов (особенно в моменты, когда наступают кризисы внимания), задавая актуальные вопросы или приводя интересные примеры и т.д. Также преподаватель должен обучать студентов навыкам конспектирования лекций. Все лекции сопровождаются мультимедийными

презентации, на которых представлены схемы, таблицы, определения терминов. Это позволяет проиллюстрировать материал, сэкономить время, быстро вернуться к любому из уже рассмотренных вопросов или вовсе изменить последовательность изложения.

4.2 Информационное обеспечение дисциплины (модуля)

4.2.1 Основное информационное обеспечение.

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины (модуля):

- e-library.kai.ru – Библиотека Казанского национального исследовательского технического университета им. А.Н. Туполева
- elibrary.ru – Научная электронная библиотека
- e.lanbook.ru - ЭБС «Издательство «Лань»
- ibook.ru - Электронно-библиотечная система Айбукс
- <http://znanium.com> - Электронно-библиотечная система Знаниум

4.2.2 Дополнительное справочное обеспечение

- www.consultant.ru – сайт справочно-правовой системы «Консультант Плюс»
- koob.ru - электронная библиотека
- improvement.ru
- time-master.ru
- time-post.ru
- time-post.ru

4.2.3 Перечень информационных технологий, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

- Microsoft® Windows Professional 7 Russian,
- Microsoft® Office Professional Plus 2010 Russian,
- антивирусная программа Kaspersky Endpoint Security 8,
- Ваш финансовый аналитик 2: Сетевой.

4.3. Кадровое обеспечение

4.3.1 Базовое образование

Высшее образование в предметной области управления рисками и /или наличие ученой степени и/или ученого звания в указанной области и /или наличие дополнительного профессионального образования – профессиональной переподготовки в области управления рисками.

4.3.2 Профессионально-предметная квалификация преподавателей

Профессионально-предметная деятельность преподавателей связана с управлением рисками. Направления научных и прикладных работ имеют непосредственное отношение к содержанию и требованиям дисциплины.

Преподаватель участвует в научно-исследовательской работе кафедры, в семинарах и конференциях по направлению исследований кафедры в рамках своей дисциплины. Руководит научно-исследовательской работой студентов, систематически выступает на региональных и международных научных конференциях, публикует научные работы.

4.3.3 Педагогическая (учебно-методическая) квалификация преподавателей

К ведению дисциплины допускаются кадры, имеющие стаж научно-педагогической работы (не менее 1 года); практический опыт работы в области управления рисками на должностях руководителей или ведущих специалистов более 3 последних лет.

Обязательное прохождение повышения квалификации (стажировки) не реже чем один раз в три года соответствующее области управления рисками, либо в области педагогики.

4.4 Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля)

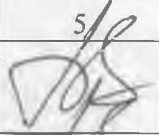
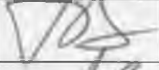
Таблица 6

Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля)

Наименование раздела (темы) дисциплины	Наименование учебной лаборатории, аудитории, класса	Перечень лабораторного оборудования, специализированной мебели и технических средств обучения	Количество единиц (шт)
Разделы 1-3 (лекции)	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа (К. 206)	- мультимедийный проектор; - ноутбук; - настенный экран; - акустические колонки; - учебные столы, стулья; - доска; - стол преподавателя; - учебно – наглядные пособия.	1 1 1 1 28;28 1 1
Разделы 1-3 (практические работы)	Учебная аудитория для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации (К. 209)	- учебные столы, стулья; - доска; - стол преподавателя; - учебно – наглядные пособия.	24;24 1 1
	Компьютерная аудитория (Л. 214)	- учебные столы, стулья; - доска; - стол преподавателя; - компьютерные столы, стулья; - персональные компьютеры; - локальная вычислительная сеть; - ЖК мониторы 23"; - проекционный экран; - мультимедиа-проектор.	15;15 1 1 15;15 15 1 15 1 1
	Помещение для самостоятельной работы студента (Л. 112)	- персональный компьютер; - ЖК монитор 19" ; - столы компьютерные; - учебные столы, стулья.	9 9 9 8;25

РАЗДЕЛ 5. ВНОСИМЫЕ ИЗМЕНЕНИЯ И УТВЕРЖДЕНИЯ

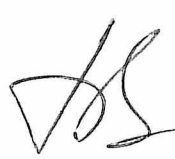
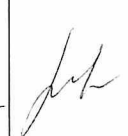
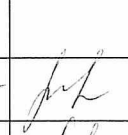
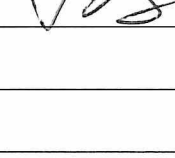
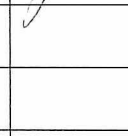
5.1 Лист регистрации изменений, вносимых в рабочую программу дисциплины (модуля)

№ п/п	№ раздела внесения изменений	Дата внесения изменений	Содержание изменений	«Согласовано» Зав. каф. ЭиМ	«Согласовано» председатель УМК филиала
1	2	3	4	5	6
1	4.2.3	26.02.2018	Дополнение в Пункт 4.2.3 Альт-Инвест Сумм 7 Альт-Финансы 2		
2	4.2.1	01.10.2018	Дополнение в пункт 4.2.1 Электронно-библиотечная система «Юрайт» http://biblio-online.ru		
3	Титуль- ный лист	31.01.2019	Изменение наименования учредителя университета. В соответствии с утверждением устава федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования «Казанский национальный исследовательский технический университет им. А.Н. Туполева-КАИ» в новой редакции (Приказ № 1042 от 26.11.2018) наименование «Министерство образования и науки Российской Федерации» читать как «Министерство науки и высшего образования Российской Федерации»		
4	4.2.1	07.09.2019	Исключить из Основного информационного обеспечения ibook.ru-ЭБС Айбукс		
5	4.1.1	07.09.2019	Заменить в Пункте 4.1.1: Дараган А.В., Самышева Е.Ю. Статистические методы управления рисками предприятия: учебное пособие. – Казань: Изд-во Казан. гос. техн. ун-та, 2014. - 150 с. На Дараган А.В., Самышева Е.Ю. Статистические методы управления рисками предприятия. [Электронный ресурс]: учебное пособие. – Казань: Изд-во Казан. гос. техн. ун-та, 2014. - 150 с. – Режим доступа: http://e-library.kai.ru/reader/hu/flipping/Resource-2449/522.pdf/index.html		
6					

РАЗДЕЛ 5. ВНОСИМЫЕ ИЗМЕНЕНИЯ И УТВЕРЖДЕНИЯ

5.1. Лист регистрации изменений, вносимых в рабочую программу дисциплины (модуля)

(продолжение)

№ п/п	№ раздела внесения изменений	Дата внесения изменений	Содержание изменений	«Согласовано» Зав. каф. ЭиМ	«Согласовано» председатель УМК филиала
1	2	3	4	5	6
6	Стр.2	01.07.2019	Первый абзац читать в следующей редакции «Рабочая программа составлена на основе требований федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (уровень бакалавриата), утвержденного приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12 ноября 2015г. № 1327, и в соответствии с учебным планом направления 38.03.01, утвержденным Ученым советом КНИТУ- КАИ «01» июля 2019г., протокол №6		
7	П.1.4	01.07.2019	Таблицы 1а и 1б читать в редакции Приложения 1		
8	П.2.1	01.07.2019	Таблицы 3а и 3б читать в редакции Приложения 2		

Приложение 1

Таблица 1а – Объем дисциплины (модуля) для очной формы обучения

Семестр	Общая трудоемкость дисциплины (модуля), в ЗЕ/час	Виды учебной работы											
		<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий (аудиторная работа), в т.ч.:</i>							<i>Самостоятельная работа обучающегося (внеаудиторная работа), в т.ч.:</i>				
		Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия	Курсовая работа (консультация, защита)	Курсовой проект (консультация, защита)	Консультации перед экзаменом	Контактная работа на промежуточной аттестации	Курсовая работа (подготовка)	Курсовой проект (подготовка)	Проработка учебного материала (самоподготовка)	Подготовка к промежуточной аттестации	Форма промежуточной аттестации
8	3 ЗЕ/108	16	-	16	-	-	2	0,3	-	-	40	33,7	Экзамен
Итого	3 ЗЕ/108	16	-	16	-	-	2	0,3	-	-	40	33,7	

Таблица 1б – Объем дисциплины (модуля) для заочной формы обучения

Семестр	Общая трудоемкость дисциплины (модуля), в ЗЕ/час	Виды учебной работы											
		<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий (аудиторная работа), в т.ч.:</i>							<i>Самостоятельная работа обучающегося (внеаудиторная работа), в т.ч.:</i>				
		Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия	Курсовая работа (консультация, защита)	Курсовой проект (консультации, защита)	Консультации перед экзаменом	Контактная работа на промежуточной аттестации	Курсовая работа (подготовка)	Курсовой проект (подготовка)	Проработка учебного материала (самоподготовка)	Подготовка к промежуточной аттестации	Форма промежуточной аттестации
8	3 ЗЕ/108	6	-	4	-	-	2	0,3	-	-	89	6,7	Экзамен
Итого	3 ЗЕ/108	6	-	4	-	-	2	0,3	-	-	89	6,7	

Приложение 2

Таблица 3а

Распределение фонда времени по видам занятий (очная форма обучения)

Наименование раздела и темы	Всего часов	Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Коды компетенций	Формы и вид контроля освоения составляющих компетенций (из фонда оценочных средств)
		лекции	лаб. раб.	пр. зан.	сам.раб.		
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками							ФОС ТК-1
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	10	2		2	6	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 1.2. Классификация рисков. Признаки классификации рисков.	15	4		4	7	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 1.3. Принципы оценки рисков. Методы оценки рисков.	15	4		4	7	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Раздел 2. Методические и практические инструменты управления рисками							ФОС ТК-2
Тема 2.1. Методы управления рисками	11	2		2	7	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 2.2. Страхование как метод управления рисками. Оптимизация бюджета капиталовложений с учетом риска.	11	2		2	7	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Раздел 3. Управление рискам в проектной деятельности							ФОС ТК-3
Тема 3.1. Оценка проекта с учетом риска. Финансирование рисков. Информационное обеспечение риск-менеджмента.	10	2		2	6	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Подготовка к промежуточной аттестации	33,7				33,7	ПК -1, ПК -11	ФОС ПА
Контактная работа на промежуточной аттестации (экзамен)	2,3					ПК -1, ПК -11	ФОС ПА
ИТОГО:	108	16		16	73,7		

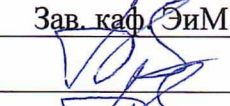
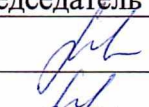
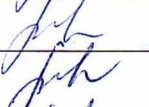
Таблица 36

Распределение фонда времени по видам занятий (заочная форма обучения)

Наименование раздела и темы	Всего часов	Виды учебной деятельности, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Коды компетенций	Формы и вид контроля освоения составляющих компетенций (из фонда оценочных средств)
		лекции	лаб. раб.	пр. зан.	сам.раб.		
Раздел 1. Теоретические аспекты управления рисками							<i>ФОС ТК-1</i>
Тема 1.1. Предмет и содержание курса	15	1			14	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 1.2. Классификация рисков. Признаки классификации рисков.	16	1		1	14	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 1.3. Принципы оценки рисков. Методы оценки рисков.	16	1		1	14	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Раздел 2. Методические и практические инструменты управления рисками							<i>ФОС ТК-2</i>
Тема 2.1. Методы управления рисками	15,5	1		0,5	14	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Тема 2.2. Страхование как метод управления рисками. Оптимизация бюджета капиталовложений с учетом риска.	15,5	1		0,5	14	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Раздел 3. Управление рискам в проектной деятельности							<i>ФОС ТК-3</i>
Тема 3.1. Оценка проекта с учетом риска. Финансирование рисков. Информационное обеспечение риск-менеджмента.	21	1		1	19	ПК -1, ПК -11	Текущий контроль
Подготовка к промежуточной аттестации	6,7				6,7	ПК -1, ПК -11	ФОС ПА
Контактная работа на промежуточной аттестации (экзамен)	2,3					ПК -1, ПК -11	ФОС ПА
ИТОГО:	108	6		4	95,7		

5.2 Лист утверждения рабочей программы дисциплины (модуля) на учебный год

Рабочая программа дисциплины (модуля) утверждена на ведение учебного процесса в учебном году:

Учебный год	«Согласовано» Зав. каф. ЭиМ	«Согласовано» председатель УМК филиала
2017/2018		
2018/2019		
2019/2020		
2020/2021		

2021 / 2022
2022 / 2023

