

МИНОБРНАУКИ РОССИИ

федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«Санкт-Петербургский государственный экономический университет»



УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной и методической работе

В.Г. Шубаева

« 26 » мая 20 21 г.

Риск-менеджмент

Рабочая программа дисциплины

Направление подготовки/ Специальность 38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль) программы/ Специализация Управление бизнесом

Уровень высшего образования Бакалавриат

Форма обучения очная

Составитель(и):

д.э.н, Растова Юлия Ивановна

Часов по учебному плану	252	Виды контроля в семестрах: Зачет: семестр 7 Экзамен: семестр 8
в том числе:		
контактная работа	96	
самостоятельная работа	120	
практическая подготовка	0	
часов на контроль	36	

Распределение часов дисциплины:

Семестр:	7,8
Вид занятий	Часы
Лекционные занятия	62
Практические занятия	34
Лабораторные работы	
Итого аудиторных часов	96
Самостоятельная работа	120
Часы на контроль	36
Итого академических часов	252
Общая трудоемкость в зачетных единицах	7

Санкт-Петербург
2021

СОДЕРЖАНИЕ

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	3
2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ	3
3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ	3
4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ*	4
5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	8
5.1 Рекомендуемая литература	8
5.2 Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в т.ч. отечественного производства	8
5.3 Перечень информационных справочных систем (ИСС) и современных профессиональных баз данных (СПБД).....	8
6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	9
7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ.....	10
8. ОСОБЕННОСТИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ ДЛЯ ИНВАЛИДОВ И ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ	11
ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ.....	13
1.1 Контрольные вопросы и задания к промежуточной аттестации	13
1.2 Темы письменных работ.....	13
1.3 Контрольные точки	13
1.4 Другие объекты оценивания	14
1.5 Самостоятельная работа обучающегося	14
1.6 Шкала оценивания результата	14

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель:	Формирование у обучающихся компетенций, необходимых для оценки и учета риска при принятии управленческих решений в различных сферах хозяйственной деятельности.
--------------	---

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Дисциплина Б1.В Риск-менеджмент относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1.

3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Код и наименование компетенции выпускника	Код и наименование индикатора достижения компетенций	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-3 - Способен организовывать эффективное взаимодействие всех структурных подразделений для реализации инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов	ПК-3.3 - Реализует бизнес-возможности с точки зрения выбранных инвестиционных целевых показателей	<p>Знать: требования законодательства международных и российских стандартов в области управления рисками; возможные методы анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе с использованием современных цифровых технологий</p> <p>Уметь: применять методы анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе с использованием современных цифровых технологий; разрабатывать документы, регламентирующие деятельность специалистов по управлению рисками.</p> <p>Владеть: навыками разработки документов, регламентирующие деятельность специалистов по управлению рисками; методами реагирования на риск при принятии стратегических решений, а также в управлении операционной (производственной) деятельностью организаций.</p>

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ*

Номер и наименование тем и/или разделов/тем	Содержание дисциплины	Объем дисциплины (академические часы)			
		Контактная работа			СРО
		ЗЛТ	ПЗ	ЛР	
Тема 1. Введение.	История и гносеология теории риска в управлении. Категория «риск» в исследованиях классической и неоклассической экономических школ. Современное состояние проблемы. Предмет и метод дисциплины, методологические основы и задачи. Структура дисциплины, взаимосвязи с другими дисциплинами учебного плана.	8	4		20
Тема 2. Сущность риска и классификация его видов.	Понятие риска. Его основные элементы и черты. Происхождение термина «риск». Условия, сопутствующие ситуации риска: наличие неопределенности, необходимость выбора альтернативы. Возможность оценки вероятности осуществления выбираемых альтернатив. Основные элементы риска. Основные черты риска: противоречивость, альтернативность, неопределенность. Причины возникновения риска при принятии и реализации управленческих решений. Субъективная природа риска. Характеристика людей в зависимости от отношения к риску. Объективная природа риска. Субъективно – объективная природа риска. Спонтанность природных явлений как причина возникновения риска. Случайность как причина возникновения риска. Наличие противоборствующих тенденций как причина возникновения риска. Вероятностный характер научно – технического прогресса как причина возникновения риска. Существование неопределенности как причина возникновения риска. Прочие причины возникновения риска. Функции предпринимательского риска. Инновационная функция риска. Регулятивная функция риска. Защитная функция риска. Аналитическая функция риска. Классификация видов предпринимательского риска. Классификация рисков по времени возникновения. Классификация рисков по характеру учета. Классификация рисков по характеру последствий. Классификация рисков по сфере возникновения. Характеристика производственного риска. Характеристика коммерческого риска. Характеристика финансового риска. Характеристика отраслевого риска. Характеристика инновационного риска. Характеристика технического риска. Характеристика политического риска.	12	4		20
Тема 3. Методы оценки риска при принятии и реализации управленческих	Вероятностные методы оценки риска. Критерии оценки риска вероятностными методами. Степень риска. Параметры оценки риска вероятностными методами. Вербальная оценка риска. Количественная оценка вероятности, соответствующая вербальной оценке степени риска.	14	6		20

решений.	<p>Эмпирическая шкала уровня риска. Методы определения вероятности наступления нежелательных событий. Объективный метод определения вероятности. Субъективный метод определения вероятности. Использование вероятностных методов при оценке рисков предпринимательских проектов. Статистические методы оценки риска. Суть статистического метода. Инструменты статистического метода. Алгоритм статистического метода. Задание исходов реализации управленческих решений. Оценка вероятности наступления прогнозируемых решений. Определение значения итогового показателя. Определение математического ожидания. Расчет дисперсии и среднеквадратического отклонения. Расчет коэффициента вариации. Шкала риска в зависимости от величины значения коэффициента вариации. Характеристика приемлемого риска. Характеристика допустимого риска. Характеристика критического риска. Характеристика ката-строфического риска. Сущность и алгоритм упрощенного статистического метода. Методы оценки чувствительности результирующих показателей. Алгоритм методов оценки чувствительности результирующих показателей. Факторный анализ прибыли от реализации продукции (выполнения работ, оказания услуг). Расчет общего изменения прибыли от реализации продукции. Расчет влияния на прибыль изменений отпускных цен на реализованную продукцию. Расчет влияния на прибыль изменений в объеме продукции. Расчет влияния на прибыль изменений в объеме продукции, обусловленных изменениями в структуре реализации продукции. Расчет влияния на прибыль экономии от снижения расходов на продукцию. Факторный анализ критического объема продаж. Изменение критического объема продаж, обусловленное изменением постоянных затрат. Изменение критического объема продаж, обусловленное изменением цен на продукцию. Изменение критического объема продаж, обусловленное изменением переменных затрат. Метод сценариев. Алгоритм метода сценариев. Построение дерева решений. Экспертные методы оценки риска. Понятие экспертизы. Особенность эвристических методов оценки риска. Индивидуальные экспертные оценки и их использование для оценки предпринимательских рисков. Коллективные экспертные оценки и их типы. Характеристика открытого обсуждения поставленных вопросов с последующим открытым или закрытым голосованием. Феномен сдвига риска. Характеристика свободного высказывания без обсуждения и голосования. Характеристика закрытого обсуждения с последующим закрытым голосованием или заполнением анкет экспертного</p>				
----------	---	--	--	--	--

	<p>опроса. Основные этапы экспертизы. Подбор экспертов и формирование экспертных групп. Формирование вопросов и составление анкет. Работа с экспертами. Формирование правил определения экспертных оценок на основе оценок отдельных экспертов. Анализ и обработка экспертных оценок. Сущность и расчет коэффициента конкордации. Принятие решений в условиях неопределенности. Классические критерии, используемые при принятии решений в условиях неопределенности. Принцип недостаточного обоснования Лапласа. Максиминный критерий Вальда. Минимаксный критерий Сэвиджа. Критерий обобщенного максимина (пессимизма – оптимизма) Гурвица. Прогнозирование рисков и неблагоприятных событий с использованием технологий искусственного интеллекта. Идентификация и выявление новых типов рисков, а также оценка вероятности наступления рисков и величины вероятных последствий при их наступлении с применением математических моделей искусственного интеллекта. Задача поиска аномалий (Anomaly Detection) в исторических массивах данных: метод трех сигм; метод эллипсоидальной аппроксимации; метод локального уровня выброса; метода изолирующего леса. Классификация (кластеризация) рисков с использованием интеллектуальных алгоритмов машинного обучения без учителя: k-means, иерархический алгоритм кластеризации, Birch. Определение вероятности наступления определенного риска способом обучения нескольких бинарных классификаторов. Модели машинного обучения в классификации рисков: логистическая регрессия; ближайшие соседи; решающие деревья; случайный лес; градиентный бустинг.</p>				
Тема 4. Принятие инвестиционных решений в условиях риска и неопределенности.	<p>Принятие инвестиционных решений в условиях риска и неопределенности. Критерии устойчивости инвестиционного проекта в целом и с точки зрения его участников. Расчет границ безубыточности. Метод вариации параметров. Оценка ожидаемого эффекта проекта с учетом количественных характеристик неопределенности. Специальные методы анализа инвестиционного риска: содержание и сравнительная характеристика. Метод корректировки нормы дисконта. Метод достоверных эквивалентов (коэффициентов определенности). Анализ вероятностных распределений потоков платежей. Понятие о реальных опционах. Ценообразование опционов. Ценность перспектив развития и управленческой гибкости. Ценность последовательного инвестирования. Опцион на выбор времени. Реальный опцион на отказ от бизнеса. Мониторинг и переоценка проектов.</p>	10	6		20
Тема 5. Риск-	<p>Понятие рисковости финансового актива. Понятие</p>	10	8		20

менеджмент участников фондового рынка.	<p>безрисковых активов. Взаимосвязь рисковости актива и его доходности. Расчет средневзвешенной ожидаемой прибыли. Расчет стандартного отклонения средневзвешенной ожидаемой прибыли. Понятие и расчет цены риска. Понятие и расчет доходности финансовых активов. Расчет средней доходности финансовых активов. Расчет дисперсии текущих доходностей относительно средней доходности финансовых активов. Типы портфелей ценных бумаг: портфель роста, портфель дохода, портфель роста и дохода, специализированные портфели ценных бумаг. Основные принципы формирования портфеля ценных бумаг. Анализ портфельных рисков. Расчет ковариации доходности каждой пары финансовых активов. Расчет коэффициента парной корреляции. Характеристика риска портфеля финансовых активов в зависимости от величины коэффициента корреляции. Расчет доходности портфеля финансовых активов. Расчет средней доходности портфеля финансовых активов. Расчет дисперсии доходности портфеля финансовых активов. Формирование безрискового портфеля финансовых активов. Понятия «эффективного», «лучшего», «рыночного» портфеля. Параметры рыночного портфеля «с размещением» и «с привлечением». Эффект финансового рычага. Модели выбора оптимального портфеля ценных бумаг: вероятностная модель Марковица, индексная модель Шарпа, арбитражная модель. САРМ в текущей оценке финансовых активов: преимущества и недостатки. Сущность и область применения способов нивелирования финансовых рисков: управление активами и пассивами; иммунизация портфеля, дюрация, процентная маржа, «спрэд», «геп», процентный своп, валютные оговорки, хеджирование.</p>				
Тема 6. Корпоративная система управления рисками (КСУР).	<p>Организация процессов управления рисками, выявления рисков, оценку рисков, управления рисками, мониторинга. Участники КСУР: Совет директоров (наблюдательный совет), комитет по аудиту в его составе, СЕО, комитет по рискам, структурное подразделение по управлению рисками, руководители других структурных подразделений (так называемые владельцы риска), подразделение внутреннего аудита. Долгосрочная стратегия развития КСУР. Политика управления рисками. План работ корпоративной системы управления рисками. Положение о Комитете по рискам. Регламент взаимодействия в рамках КСУР. Эффективность функционирующей системы управления рисками. Внутренний аудит КСУР.</p>	8	6		20
Контроль:					36
Всего по дисциплине:		62	34	0	120

*ЗЛТ – занятия лекционного типа, ПЗ – все виды занятий семинарского типа, кроме лабораторных работ, ЛР – лабораторные работы, СРО – самостоятельная работа обучающегося

5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Рекомендуемая литература

Библиографическое описание издания (автор, заглавие, вид, место и год издания, кол. стр.)	Электронные ресурсы
Растова Ю.И., Растов М.А. Риск-менеджмент: учебное пособие. – СПб.: СПбГЭУ, 2016. – 80 с.	http://opac.unecon.ru/elibrary ... B6%D0%BC%D0%B5%D0%BD%D1%82.pdf
Покровский А.К. Риск-менеджмент на предприятиях промышленности и транспорта: учебное пособие. – М.: КноРус, 2021. – 160 с.	https://reader.new.book.ru/?t= ... ALPHKxpbHbcBYq7wMvc9Q&v=0
Гончаренко Л.П., Филин С.А., Олейников Е.А. Риск-менеджмент: учебное пособие. – М.: КноРус, 2016. – 215 с. – Бакалавриат и Магистратура.	https://reader.new.book.ru/?t= ... 6R8KM6issJNY2LzfRY Yw&v=0
Кричевский М.Л. Финансовые риски: учебное пособие. – М.: КноРус, 2020. – 270 с. – Для бакалавров.	https://reader.new.book.ru/?t= ... 5njDFowgfk0mDy5upnh3A&v=0
Грибов В.Д. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски: учебное пособие. – М.: КноРус, 2017. – 291 с. – Для бакалавров.	https://reader.new.book.ru/?t= ... q1TYUZnzS-MQO-XSCslWQ&v=0

5.2 Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в т.ч. отечественного производства

- 7-Zip
- Microsoft Office Professional
- Microsoft Windows Professional

5.3 Перечень информационных справочных систем (ИСС) и современных профессиональных баз данных (СПБД)

№	Наименование СПБД/ ИСС
1.	Электронная библиотека Grebennikon.ru – www.grebennikon.ru
2.	Научная электронная библиотека eLIBRARY – www.elibrary.ru
3.	Научная электронная библиотека КиберЛеника – www.cyberleninka.ru
4.	База данных ПОЛПРЕД Справочники – www.polpred.com
5.	База данных OECD Books, Papers & Statistics на платформе OECD iLibrary www.oecd-ilibrary.org
6.	Справочная правовая система КонсультантПлюс (инсталлированный ресурс СПБГЭУ или www.consultant.ru)

7.	Справочная правовая система «ГАРАНТ» (инсталлированный ресурс СПбГЭУ или www.garant.ru)
8.	Информационно-справочная система «Кодекс» (инсталлированный ресурс СПбГЭУ или www.kodeks.ru)
9.	Электронная библиотечная система BOOK.ru - www.book.ru
10.	Электронная библиотечная система ЭБС ЮРАЙТ – www.urait.ru
11.	Электронно-библиотечная система ЗНАНИУМ (ZNANIUM) – www.znanium.com
12.	Электронная библиотека СПбГЭУ – opac.unicon.ru

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для реализации данной дисциплины имеются специальные помещения для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ) групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы.

Помещения оснащены оборудованием и техническими средствами обучения.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета.

Наименование учебных аудиторий, перечень	Адрес (местоположение) учебных аудиторий
Ауд. 219 Учебная аудитория (для проведения занятий лекционного типа и занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации), оборудована мультимедийным комплексом. Специализированная мебель и оборудование: Учебная мебель на 40 посадочных мест, рабочее место преподавателя, доска меловая 1 шт., тумба м/м Моноблок Acer Aspire Z1811 в компл.: i5 2400s/4Gb/1Tб - 1 шт., Мультимедийный проектор NEC ME402X - 1 шт., Экран с электроприводом 153x200 см Matte White - 1 шт., Микшер усилитель Jedia TA-1120 в комплекте - 1 шт., Акустическая система Hi-Fi PRO MASK6T-W - 2 шт. Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий: мультимедийные приложения к лекционным курсам и практическим занятиям, интерактивные учебно-наглядные пособия.	191002, г. Санкт-Петербург, Кузнечный пер., д. 9/27, лит. А
Ауд. 604 Учебная аудитория (для проведения занятий лекционного типа и занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации), оборудована мультимедийным комплексом. Специализированная мебель и оборудование: Учебная мебель на 88 посадочных мест, рабочее место преподавателя, доска меловая 1 шт., трибуна, тумба м/м, Моноблок Acer Aspire Z1811 в компл.: i5 2400s/4Gb/1Tб/ - 1 шт., Мультимедийный проектор NEC ME402X - 1 шт., Экран с электроприводом 183x240 см Компакт - 1 шт. Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий: мультимедийные приложения к лекционным курсам и практическим занятиям, интерактивные учебно-наглядные пособия.	191002, г. Санкт-Петербург, Кузнечный пер., д. 9/27, лит. А

<p>Ауд. 208 Учебная аудитория (для проведения занятий лекционного типа и занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации), оборудована мультимедийным комплексом. Специализированная мебель и оборудование: Учебная мебель на 32 посадочных мест, рабочее место преподавателя, доска меловая 1 шт., парта 10 шт., скамейка 10 шт., тумба м/м Компьютер I3-8100/ 8Гб/500Гб/Philips224E5QSB - 20 шт., Компьютер i5-7400 3 Gh/8Gb/1Tb/Dell e2318h - 1 шт., Мультимедийный проектор 1 NEC ME401X - 1 шт., Экран с электроприводом 153x200 см Matte White - 1 шт., Коммутатор HP ProCurve Switch 2610-24 (24 ports 10/100+2 10/100/1000) - 1 шт. Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий: мультимедийные приложения к лекционным курсам и практическим занятиям, интерактивные учебно-наглядные пособия.</p>	<p>191002, г. Санкт-Петербург, Кузнечный пер., д. 9/27, лит. А</p>
---	--

7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Приступая к изучению дисциплины, обучающемуся необходимо ознакомиться со следующими документами:

- учебно-методической документацией;
- локальными нормативными актами, регламентирующими основные вопросы организации и осуществления образовательной деятельности, в том числе регламентирующие порядок проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся;
- графиком консультаций сотрудников профессорско-преподавательского состава.

Уровень и глубина освоения дисциплины определяются активной и систематической работой обучающихся на лекционных занятиях, занятиях семинарского типа, выполнением самостоятельной работы, в том числе в части выделения наиболее значимых и актуальных проблем для дальнейшего изучения. Особым условием качественного освоения дисциплины является эффективная организация труда, позволяющая распределить учебную нагрузку равномерно в соответствии с графиком учебного процесса.

При подготовке к учебным занятиям обучающимся предоставляется возможность посещения консультаций сотрудников профессорско-преподавательского состава СПбГЭУ согласно расписанию, установленному в графике консультаций.

Аудиторная и внеаудиторная работа обучающихся должна быть направлена на формирование:

- фундаментальных основ мировоззрения обучающихся и естественнонаучного познания;
- базисных знаний, соответствующих направлению подготовки и заявленной профессиональной области, формирующих целевую и профессиональную основу для подготовки кадров;

- профессиональных компетенций ориентированных на удовлетворение потребностей рынка труда;
- индивидуальной траектории посредством освоения уникального набора профессиональных компетенций дополняющих компетентностную модель обучающегося, за счет ориентации на конкретные профессиональные специализированные области знаний, определяемые представителями рынка труда;
- метанавыков обучающихся, таких как: командная работа и лидерство, анализ данных, цифровые навыки, разработка и реализация проектов, межкультурное взаимодействие.

8. ОСОБЕННОСТИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ ДЛЯ ИНВАЛИДОВ И ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

Обучение обучающихся с ограниченными возможностями здоровья при необходимости осуществляется на основе адаптированной рабочей программы с использованием специальных методов обучения и дидактических материалов, составленных с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья таких обучающихся (обучающегося).

В целях освоения учебной программы дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья Университет обеспечивает:

- для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по зрению: размещение в доступных для обучающихся, являющихся слепыми или слабовидящими, местах и в адаптированной форме справочной информации о расписании учебных занятий; присутствие ассистента, оказывающего обучающемуся необходимую помощь; выпуск альтернативных форматов методических материалов (крупный шрифт или аудиофайлы);

- для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по слуху: надлежащими звуковыми средствами воспроизведение информации;

- для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья, имеющих нарушения опорно-двигательного аппарата: возможность беспрепятственного доступа обучающихся в учебные помещения, туалетные комнаты и другие помещения кафедры, а также пребывание в указанных помещениях.

Обучающиеся из числа инвалидов и лиц с ОВЗ обеспечены печатными и (или) электронными образовательными ресурсами в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья. Образование обучающихся с

ограниченными возможностями здоровья может быть организовано как совместно с другими обучающимися, так и в отдельных группах или в отдельных организациях.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

1.1 Контрольные вопросы и задания к промежуточной аттестации

- 1 Эволюция науки риск-менеджмента.
- 2 Цели и задачи риск-менеджмента в организации.
- 3 Принятие управленческих решений в условиях неопределенности экономической среды.
- 4 Основные подходы к классификации рисков.
- 5 Количественные и качественные методы анализа рисков.
- 6 Оценка риска вероятностными методами.
- 7 Статистические методы оценки риска.
- 8 Методы оценки чувствительности результирующих показателей.
- 9 Метод сценариев.
- 10 Экспертные методы оценки риска.
- 11 Критерии устойчивости инвестиционного проекта.
- 12 Расчет границ безубыточности и чувствительности проекта.
- 13 Количественные характеристики неопределенности условий реализации проекта.
- 14 Реальные опционы.
- 15 Характеристика риска портфеля финансовых активов.
- 16 «Эффективный», «лучший», «рыночный» портфели.
- 17 Модели выбора оптимального портфеля ценных бумаг.
- 18 Способы нивелирования финансового риска.
- 19 Структура КСУР и распределение полномочий.
- 20 Разработка внутренних документов КСУР.
- 21 Бизнес-процессы в системе КСУР.
- 22 Оценка эффективности КСУР.

1.2 Темы письменных работ

Рабочей программой дисциплины не предусмотрено.

1.3 Контрольные точки

Номер контрольной точки	Тип контрольной точки	Способ проведения	Номера тем
1	Тест	с помощью технических средств и информационных систем	1-2
2	Контрольная работа	с помощью технических средств и информационных систем	3
3	Текущий контроль	с помощью технических средств и информационных систем	1-3
4	Тест	с помощью технических средств	4-5

		и информационных систем	
5	Контрольная работа	письменно	6
6	Текущий контроль	с помощью технических средств и информационных систем	4-6

1.4 Другие объекты оценивания

Наименования объекта оценивания	Способ проведения	Номера тем
Индивидуальное задание	письменно	3-4
Аналитическая работа	с помощью технических средств и информационных систем	5-6

1.5 Самостоятельная работа обучающегося

Наименования самостоятельной работы	Номера тем
Подготовка к лекционным и практическим занятиям	1-6
Работа с аналитическими базами данных, нормативными документами, справочной литературой	5-6
Выполнение домашних заданий	2-5
Выполнение расчетных, аналитических, расчетно-графических и др. заданий	3-4
Подготовка к экзамену	1-6

1.6 Шкала оценивания результата

Шкалы оценивания и процедуры оценивания результатов обучения **по дисциплине** регламентируются Положением о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по программам высшего образования и Положением о балльно-рейтинговой системе.

Для оценки сформированности результатов обучения по дисциплине используется **балльно-рейтинговая система успеваемости обучающихся**:

Формой итогового контроля по дисциплине является экзамен (или дифференцированный зачет), итоговая оценка формируется в соответствии со шкалой, приведенной ниже в таблице:

Баллы	Оценка
≤ 54	неудовлетворительно
55-69	удовлетворительно
70-84	хорошо
≥ 85	отлично

Шкала оценивания результата

2 (балл до 54)	Демонстрирует непонимание проблемы. Многие требования, предъявляемые к заданию не выполнены. Демонстрируется первичное восприятие материала. Работа незакончена и /или это плагиат.
3 (балл 55-69)	Демонстрирует частичное понимание проблемы. Большинство требований, предъявляемых, к заданию выполнены. Владение элементами заданного материала. В основном выполненный материал понятен и носит целостный характер.
4 (балл 70-84)	Демонстрирует значительное понимание проблемы обозначенной дисциплиной. Все требования, предъявляемые к заданию выполнены. Содержание выполненных заданий раскрыто и рассмотрено с разных точек зрения.
5 (балл 85-100)	Демонстрирует полное понимание проблемы. Все требования, предъявляемые к заданию выполнены. Продemonстрировано уверенное владение материалом дисциплины. Выполненные задания носят целостных характер, выполнены в полном объеме, структурированы, представлены различные точки зрения, продемонстрирован творческий подход.