

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Шамсутдинов Рустам Салаватович
Должность: Директор филиала
Дата подписания: 28.08.2024 16:42:11
Уникальный программный ключ:
084431041bf624ef36a46b0c0e279fcaadb77cb9

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования «Казанский национальный исследовательский
технический университет им. А.Н. Туполева-КАИ»**

Альметьевский филиал



УТВЕРЖДАЮ

Директор филиала

С.В. Юдина

«02»

07

2021 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины (модуля)

«Б1.В.12 Анализ и прогноз рыночных рисков»

Квалификация: **бакалавр**

Форма обучения: **очная, очно-заочная**


Направление подготовки: **38.03.02 Менеджмент**

Направленность (профиль): **Управление бизнесом и человеческими ресурсами**

Альметьевск 2021 г.

Рабочая программа дисциплины (модуля) разработана в соответствии с требованиями Ф ГОС ВО по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 12.08.2020 № 970

Разработчик (и):

Серикова Наталья Владимировна, канд.экон.наук, доцент 

(ФИО, ученая степень, ученое звание)



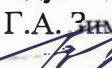
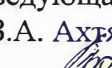
(подпись)

(ФИО, ученая степень, ученое звание)

(подпись)

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры ЭМ протокол от «10» июня 2021г. № 11.

Заведующий кафедрой ЭМ, Н.В. Серикова, канд.экон.наук, доцент

Рабочая программа дисциплины (модуля)	Наименование подразделения	Дата	№ протокола	Подпись
ОДОБРЕНА	Кафедра, ответственная за ОП	10.06.21	№:11	зав. кафедрой Н.В. Серикова  (подпись)
ОДОБРЕНА	Учебно-методическая комиссия АФ КНИТУ-КАИ	11.06.21	№:3	председатель УМК Г.М. Муфаярова  (подпись)
СОГЛАСОВАНА	Научно-техническая библиотека АФ КНИТУ-КАИ	10.06.21	-	заведующая НТБ Г.А. Зинина  (подпись)
СОГЛАСОВАНА	Учебно-методический отдел АФ КНИТУ-КАИ	10.06.21	-	заведующая УМО З.А. Ахтямова  (подпись)

1 ИСХОДНЫЕ ДАННЫЕ И КОНЕЧНЫЙ РЕЗУЛЬТАТ ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

1.1 Цель изучения дисциплины (модуля)

Основной целью изучения дисциплины (модуля) является формирование у обучающихся целостного представления о существующих технологиях определения и формализации рисков событий, а также методах их анализа, контроля, прогнозирования и управления ими.

1.2 Задачи дисциплины (модуля)

Основными задачами дисциплины (модуля) являются:

1. Ознакомление обучающихся с концепцией и методологией управления рыночными рисками.
2. Изучение экономических и правовых основ управления рыночными рисками.
3. Овладение обучающимися методами анализа, прогнозирования и управления рыночными рисками.
4. Изучение методов выявления, анализа, прогнозирования и оценки рыночных рисков.
5. Овладение обучающимися навыками разработки планов по недопущению рисков, либо минимизации их негативных воздействий на деятельность предприятий и организаций.
6. Привитие устойчивых навыков использования методов и инструментов анализа, прогнозирования и управления рыночными рисками.

1.3 Место дисциплины (модуля) в структуре ОП ВО

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений, Блока 1. Дисциплины (модули) образовательной программы.

1.4 Объем дисциплины (модуля) и виды учебной работы

Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебной работы) и на самостоятельную работу обучающихся представлены в таблице 1.1

Таблица 1.1, а – Объем дисциплины (модуля) для очной формы обучения

Семестр	Общая трудоемкость дисциплины (модуля), в ЗЕ/час	Виды учебной работы, в т.ч. проводимые с использованием ЭО и ДОТ												
		<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебной работы (аудиторная работа)</i>							<i>Самостоятельная работа обучающегося (внеаудиторная работа)</i>					
		Лекции/в т.ч. в форме практической подготовки	Лабораторные работы/в т.ч. в форме практической подготовки	Практические занятия/в т.ч. в форме практической подготовки	Курсовая работа (консультации, 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	
7	5 ЗЕ/180	16	–	16	–	–	2	0,2	–	–	112	33,8	Экзамен	
Итого	5 ЗЕ/180	16	–	16	–	–	2	0,2	–	–	112	33,8		

Таблица 1.1, б – Объем дисциплины (модуля) для очно-заочной формы обучения

Семестр	Общая трудоемкость дисциплины (модуля), в ЗЕ/час	Виды учебной работы, в т.ч. проводимые с использованием ЭО и ДОТ												
		<i>Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебной работы (аудиторная работа)</i>							<i>Самостоятельная работа обучающегося (внеаудиторная работа)</i>					
		Лекции/в т.ч. в форме практической подготовки	Лабораторные работы/в т.ч. в форме практической подготовки	Практические занятия/в т.ч. в форме практической подготовки	Курсовая работа (консультации, 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	
7	5 ЗЕ/180	12	–	12	–	–	2	0,2	–	–	120	33,8	Экзамен	
Итого	5 ЗЕ/180	12	–	12	–	–	2	0,2	–	–	120	33,8		

1.5 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю)

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование компетенций, представленных в таблице 1.2.

Таблица 1.2 – Формируемые компетенции

Код компетенции	Наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций	Планируемые результаты обучения
ПК- 1	Способен к теоретическому обобщению результатов бизнес-анализа для формирования возможных управленческих решений	ИД-2 _{ПК-1} Формирует возможные управленческие решения на основе теоретического обобщения результатов бизнес-анализа	Знает: методы идентификации рисков Умеет: выявлять риски на основе теоретического обобщения результатов бизнес-анализа Владеет: навыками анализа выявленных рисков для разработки управленческих решений
ПК-4	Способен осуществлять анализ информации о рисках, разрабатывать мероприятия по управлению рисками и производить их мониторинг	ИД-1 _{ПК-4} Идентифицирует и анализирует риски проекта или предприятия	Знает: методы анализа рисков Умеет: осуществлять качественный и количественный анализ рисков Владеет: навыками составления реестров рисков
ПК-4	Способен осуществлять анализ информации о рисках, разрабатывать мероприятия по управлению рисками и производить их мониторинг	ИД-2 _{ПК-4} Проводит оценку рисков проекта или предприятия	Знает: методы оценки рисков Умеет: осуществлять оценку рисков проекта или предприятия в целом Владеет: навыками использования различных методов оценки рисков проекта или предприятия
ПК-4	Способен осуществлять анализ информации о рисках, разрабатывать мероприятия по управлению рисками и производить их мониторинг	ИД-3 _{ПК-4} Разрабатывает меры по снижению рисков проекта или предприятия	Знает: методы минимизации негативных воздействий рисков Умеет: разрабатывать меры по снижению негативного влияния рисков на проект или предприятие Владеет: навыками разработки оптимальных планов по снижению негативного влияния рисков на проект или предприятие
ПК-5	Способен участвовать в разработке методической и нормативной базы системы управления рисками и принципов управления рисками в рамках отдельных бизнес-процессов и	ИД-1 _{ПК-5} Понимает основные принципы управления рисками в рамках различных бизнес-процессов и функциональных направлений	Знает: основные принципы управления рисками Умеет: использовать основные принципы управления рисками применительно к конкретному бизнес-процессу или функциональному направлению Владеет: навыками определения особенностей работы с рисками в рамках определенного бизнес-процесса или функционального направления

	функциональных направлений		
ПК-5	Способен участвовать в разработке методической и нормативной базы системы управления рисками и принципов управления рисками в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений	ИД-2 _{ПК-5} Разрабатывает методическую и нормативную базу системы управления рисками, включая разработку стандартов, процедур и политик	<p>Знает: основные принципы разработки методической и нормативной базы системы управления рисками</p> <p>Умеет: использовать основные принципы разработки методической и нормативной базы системы управления рисками применительно к конкретному бизнес-процессу или функциональному направлению</p> <p>Владеет: навыками разработки методической и нормативной базы системы управления рисками с учетом особенностей работы с рисками в рамках определенного бизнес-процесса или функционального направления</p>
ПК-6	Способен осуществлять работы по тактическому планированию деятельности структурных подразделений (отделов, цехов) производственной организации, исходя из конкретных условий и потребностей рынка и использования резервов производства	ИД-2 _{ПК-6} Участвует в разработке тактических планов развития предприятия	<p>Знает: способы разработки тактических планов развития предприятия с учетом рисков</p> <p>Умеет: разрабатывать тактические планы развития в рамках определенного бизнес-процесса или функционального направления с учетом рисков</p> <p>Владеет: навыками разработки тактических планов развития с учетом особенностей реализации рисков в определенной сфере</p>

2 СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

2.1 Структура дисциплины (модуля)

Содержание дисциплины (модуля), структурированное по разделам, с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных работ приведены в таблице 2.1.

Таблица 2.1, а – Разделы дисциплины (модуля) и виды учебной работы (очная форма обучения)

Наименование разделов дисциплины (модуля)	Всего (час)	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебной работы (в час)			Индивидуальная контактная работа	Самостоятельная работа: проработка учебного материала (самоподготовка), выполнение курсовой работы/проекта, подготовка к ПА
		Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия		
Семестр 7						
Раздел № 1. Выявление, анализ и оценка рыночных рисков	45	4	–	4	–	37
Раздел № 2. Прогнозирование и управление рыночными рисками	49	6	–	6	–	37
Раздел № 3. Система прогнозирования и управления рыночными рисками на предприятии	50	6	–	6	–	38
Экзамен	36	–	–	–	2,2	33,8
Итого за 7 семестр	180	16	–	16	2,2	145,8
Итого по дисциплине	180	16	–	16	2,2	145,8

Таблица 2.1, б – Разделы дисциплины (модуля) и виды учебной работы
(очно-заочная форма обучения)

Наименование разделов дисциплины (модуля)	Всего (час)	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебной работы (в час)			Индивидуальная контактная работа	Самостоятельная работа: проработка учебного материала (самоподготовка), выполнение курсовой работы/проекта, подготовка к ПА
		Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия		
Семестр 7						
Раздел № 1. Выявление, анализ и оценка рыночных рисков	48	4	–	4	–	40
Раздел № 2. Прогнозирование и управление рыночными рисками	48	4	–	4	–	40
Раздел № 3. Система прогнозирования и управления рыночными рисками на предприятии	48	4	–	4	–	40
Экзамен	36	–	–	–	2,2	33,8
Итого за 7 семестр	180	12	–	12	2,2	153,8
Итого по дисциплине	180	12	–	12	2,2	153,8

2.2 Содержание разделов дисциплины (модуля)

Раздел № 1. Выявление, анализ и оценка рыночных рисков

Тема 1.1 Введение в курс управления рисками. Классификация рыночных рисков.

Предмет, цель и задачи курса. Сущность понятий «риск» и «управление рисками». Неопределенность и риск в предпринимательской сфере. Факторы риска. Вероятность рисков. Мера риска. Основные характеристики рисков. Виды рисков по характеристикам неопределенности. Виды рисков по характеристикам последствий. Классификация рисков по сфере возникновения. Внешние и внутренние риски. Классификация по периоду существования. Классификация по изменению степени риска во времени. Чистые и спекулятивные риски. Экономические и неэкономические риски. Классификация по виду ценностей, подверженных риску. Классификация по виду ресурсов, с которыми связан риск.

Тема 1.2 Постановка задачи управления рыночными рисками. Схема управления рисками. Цели и требования риск-менеджмента. Цели на

этапе «после события». Обеспечение выживания организации. Обеспечение непрерывности деятельности. Обеспечение прибыли на заданном уровне. Обеспечение стабильности показателей. Обеспечение роста. Требования на этапе «до события». Обеспечение приемлемого уровня риска. Обоснованность расходов на управление рисками. Законность управления рисками. Ограничения риск-менеджмента. Принятие решения о создании системы управления рисками.

Тема 1.3 Идентификация рисков. Методы анализа риска. Оценка риска.

Идентификация риска как процесс выявления и описания рисков. Основные этапы идентификации рисков. Реестр рисков. Сущность и содержание основных и дополнительных методов выявления рисков. Опросные (оценочные) листы. Структурные диаграммы. Карты потоков (потокосные диаграммы). Прямая инспекция. Анализ статистической, финансовой и управленческой отчетности. Использование схем принятия решений в хозяйствующем субъекте; схем денежных, ресурсных и информационных потоков; процесса документооборота; описания произошедших аварий; экспертных поездок для идентификации рисков. Проблемы идентификации.

Качественный и количественный анализ риска. Статистические методы. Метод Монте-Карло. Метод анализа вероятностных распределений потоков платежей. Дерево решений. Имитационное моделирование. Аналитические методы. Анализ чувствительности. Метод корректировки нормы дисконта с учетом риска. Метод достоверных эквивалентов. Метод сценариев. Метод экспертных оценок. Метод Дельфи.

Оценка вероятности рисковых событий. Оценка последствий наступления рисковых ситуаций. Основные виды ущербов и потерь при реализации риска. 9 Интегральная оценка риска. Метод аналогий. Анализ целесообразности затрат. Сценарный метод. Имитационный метод.

Раздел № 2. Прогнозирование и управление рыночными рисками

Тема 2.1 Методы трансформации рисков.

Отказ от риска. Метод снижения частоты ущерба или предотвращения убытка. Метод уменьшения размера убытка. Метод разделения риска. Метод аутсорсинга риска.

Тема 2.2 Методы финансирования рисков.

Покрытие убытка из текущего дохода. Покрытие убытка из резервов. Покрытие убытка за счет использования займа. Самострахование. Страхование. Покрытие убытка на основе нестрахового пула. Покрытие убытка за счет

передачи ответственности на основе договора. Покрытие убытка на основе поддержки государственных и муниципальных органов. Покрытие убытка на основе спонсорства.

Раздел № 3. Система прогнозирования и управления рыночными рисками на предприятии.

Тема 3.1 Общая характеристика системы прогнозирования и управления рыночными рисками.

Цели и задачи системы управления рисками. Свойства системы управления рисками. Принципы управления рисками. Функции системы управления рисками. Внешние и внутренние ограничения системы управления рисками.

Тема 3.2 Организация системы управления рисками на предприятии. Управление рисками и стратегия развития фирмы. Управление рисками и организационная структура. Аутсорсинг управления рисками. Специфика управления портфелем рисков. Управление риском как динамический процесс.

Тема 3.3 Этапы управления рисками.

Идентификация и анализ рисков. Анализ альтернативных методов управления риском. Выбор методов управления рисками. Реализация выбранного метода управления рисками.

Мониторинг результатов и совершенствование системы управления рисками.

Взаимосвязи между этапами управления рисками. Стратегическое и тактическое планирование мероприятий по управлению рисками. Принятие управленческих решений в условиях риска.

2.3 Курсовая работа (курсовой проект)

Не предусмотрен(а) учебным планом.

3 ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ И МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

3.1 Содержание оценочных материалов и их соответствие запланированным результатам обучения

Текущий контроль успеваемости обеспечивает оценивание хода освоения дисциплины (модуля). Перечень оценочных средств текущего контроля представлен в таблице 3.1.

Таблица 3.1 – Оценочные средства текущего контроля

Виды учебных занятий	Наименование оценочного средства текущего контроля	Код и индикатор достижения компетенции
Лекции	Тестовые задания текущего контроля по разделам дисциплины	ИД-2пк-1 ИД-1пк-4 ИД-2пк-4 ИД-3пк-4 ИД-1пк-5 ИД-2пк-5 ИД-2пк-6
Практические занятия	Вопросы для подготовки к практическим занятиям	ИД-2пк-1 ИД-1пк-4 ИД-2пк-4 ИД-3пк-4 ИД-1пк-5 ИД-2пк-5 ИД-2пк-6
Самостоятельная работа	Вопросы для самоподготовки	ИД-2пк-1 ИД-1пк-4 ИД-2пк-4 ИД-3пк-4 ИД-1пк-5 ИД-2пк-5 ИД-2пк-6

Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующие процесс формирования компетенций в ходе освоения образовательной программы.

Примеры тестовых заданий текущего контроля:

1. Детерминированность - это...

- а. ситуация, когда известно состояние объекта
- б. ситуация, когда неизвестно состояние объекта

2. Индетерминированность - это...

- а. ситуация, когда известно состояние объекта

б. ситуация, когда неизвестно состояние объекта

3. Неопределенность - это отсутствие или недостаток...

1. ясности относительно состояния рассматриваемого объекта

2. уверенности относительно состояния рассматриваемого объекта

3. ясности и уверенности относительно состояния рассматриваемого объекта

4. Фактор риска - это условие, параметр, показатель, оказывающий влияние на процесс и результат этого процесса

а. Верно

б. Неверно

5. Фактор, для которого известны все значения, которые он примет в течение рассматриваемого периода, называется...

а. Определенным фактором

б. Неопределенным фактором

6. Поведенческая неопределенность относится к типу стохастической неопределенности

а. Верно

б. Неверно

7. Вероятность отражает относительную частоту наступления события в серии наблюдений

а. Верно

б. Неверно

8. Мера риска - это...

а. вероятность наступления рискованного события

б. последствия рискованного события

в. произведение вероятности наступления рискованного события на его последствия

9. Физиологические реакции и свойства организма конкретного человека относятся к причинам следующих рисков:

а. социума

б. природных

в. «человеческого фактора»

10. Мотивированные решения и поступки работников относятся к рискам...
- а. физиологическим
 - б. поведенческим
 - в. техническим

Примеры вопросов для подготовки к практическим занятиям:

1. Что такое экономический риск?
2. Что понимается под неопределенностью?
3. Какие бывают виды неопределенности?
4. Под воздействием каких факторов формируется неопределенность?
5. Как взаимосвязаны величины риска и прибыли?
7. Как проявляются материальные потери?
8. В чем заключаются финансовые потери?
9. Группы факторов рисков промышленного предприятия.
10. От чего зависит внешний риск предприятия?
11. Содержание внутреннего риска предприятия.
12. В чем заключаются транспортные риски?
13. Влияние финансовых рисков на деятельность предприятия.
14. С чем связан отраслевой риск?
15. Причины операционных рисков.
16. Классификация факторов риска по уровню процесса принятия решений.
17. Содержание рисков на входе предприятия (организации).
18. На чем основывается концепция приемлемого риска?
19. Процесс формирования системы управления рисками.
20. Содержание планирования и принятия решений в области управления рисками.
21. Какие методы оценки рисков являются статистическими?
22. Методы экспертных оценок рисков.
23. В чем заключается метод «дерева решений» оценки рисков?
24. Вероятностные подходы к измерению риска.
25. Какие аспекты должна отражать программа управления рисками на предприятии?

Пример практического задания
«ВЫБОР ОПТИМАЛЬНОГО РЕШЕНИЯ В УСЛОВИЯХ РИСКА С
ПРИМЕНЕНИЕМ ДЕРЕВА РЕШЕНИЙ»

Задание:

При крупном автомобильном магазине планируется открыть мастерскую по предпродажному обслуживанию и гарантийному ремонту автомобилей.

Консультационная фирма готова предоставить дополнительную информацию о том, будет ли рынок благоприятным или нет. Эти сведения обойдутся магазину в 13 тыс. руб. Администрация магазина считает, что эта информация гарантирует благоприятный рынок с вероятностью 0,5. Если рынок будет благоприятным, то большая мастерская принесет прибыль в 60 тыс. руб., а маленькая – 30 тыс. руб.

При неблагоприятном рынке магазин потеряет 65 тыс. руб., если будет открыта большая мастерская, и 30 тыс. руб. - если откроется маленькая. Не имея дополнительной информации, директор оценивает вероятность благоприятного рынка как 0,6. Положительный результат обследования гарантирует благоприятный рынок с вероятностью 0,8. При отрицательном результате рынок может оказаться благоприятным с вероятностью 0,3.

Постройте дерево решений и определите:

- 1) Следует ли заказать консультационной фирме дополнительную информацию, уточняющую конъюнктуру рынка?
- 2) Какую мастерскую следует открыть при магазине: большую или маленькую?
- 3) Какова ожидаемая денежная оценка наилучшего решения?
- 4) Какова ожидаемая ценность дополнительной информации?

Примерные вопросы к защите практической работы по теме 2.2

1. Метод дерева решений как способ нахождения оптимального решения
2. Типы узлов в дереве решений
3. Этапы поиска оптимального решения с использованием дерева решений

Примеры вопросов для самоподготовки:

1. Неопределенность. Риск. Вероятность рисков.
2. Случай, вероятность и воздействие.
3. Объективный и субъективный методы определения вероятности нежелательных событий.
4. Дерево рисков (структура разбиения рисков) проекта.
5. Внешние факторы риска.
6. Внутренние факторы риска.
7. Сущность статистических методов анализа рисков предприятия.

8. Статистические методы, определяющие степень риска предприятия с помощью вероятности наступления событий.
9. Риск как мера неопределенности ожидаемого дохода.
10. Риск как мера колеблемости дохода

3.2 Содержание оценочных материалов промежуточной аттестации

Промежуточная аттестация обеспечивает оценивание промежуточных результатов обучения по дисциплине (модулю).

Для оценки степени сформированности компетенций используются оценочные материалы, включающие тестовые задания и контрольные (экзаменационные) вопросы.

Примеры тестовых заданий промежуточной аттестации:

1. Причиной технического риска является...
 - а. непредсказуемое функционирование технических систем
 - б. неконтролируемое функционирование технических систем
 - в. все ответы верны

2. Причинами возникновения неопределенности как источника экономического риска является:
 - а. Наличие противоборствующих тенденций, столкновение противоречивых интересов
 - б. Спонтанность природных процессов и явлений, стихийные бедствия
 - в. Случайность, вероятностный и многовариантный характер отношений (материальных и других) между людьми
 - г. Неполнота, недостаточность информации
 - д. Все перечисленное верно

3. К функциям объекта управления риском относятся все перечисленные кроме:
 - а. Организация людей с целью предотвращения риска
 - б. Контроль за выполнением риск-программы
 - в. Работа по снижению величины риска
 - г. Страхование риска
 - д. Организация экономических связей между субъектами хозяйственного процесса

4. Управление рисками - это комплекс мероприятий направленных на:
 - а. Прогнозирование рискованных ситуаций в условиях неопределенности

- б. Обоснование принятия риска при определенных условиях
- в. Нейтрализацию риска до минимума
- г. Все перечисленное верно

5. Математический признак, означающий возможность рассчитать частоту наступления события при наличии достаточного количества статистических данных (наблюдений) – это:

- а. Случайность события
- б. Вероятность события
- в. Закономерность
- г. Алгоритм развития события
- д. Все перечисленное верно

6. Рисковым ситуациям присущи такие черты, кроме:

- а. Редкость
- б. Уникальность
- в. Дискретность
- г. Полная предсказуемость
- д. Повторяемость

7. Рисковая ситуация несет только:

- а. Одни убытки
- б. Более высокие доходы
- в. Вероятность и доходов и убытков
- г. Все перечисленное верно

8. Черта окружающей действительности и риск, которая представляет собой незнание достоверного, отсутствие однозначности - это:

- а. Противоречивость
- б. Неопределенность
- в. Альтернативность
- г. Все перечисленное верно

9. Видами опасностей и угроз в современном мире является:

- а. Потенциальная
- б. Реальная
- в. Техногенная
- г. Социально-экономическая
- д. Природная

10. Распределение риска на отдельные группы по определенным признакам для достижения определенных целей – это:

- а. Классификация рисков
- б. Структуризация рисков
- в. Алгоритмизация рисков

Примеры экзаменационных вопросов:

1. Неопределенность. Риск. Вероятность рисков.
2. Случай, вероятность и воздействие. Объективный и субъективный методы определения вероятности нежелательных событий.
3. Дерево рисков (структура разбиения рисков) проекта. Внешние факторы риска. Внутренние факторы риска.
4. Сущность статистических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия.
5. Статистические методы, определяющие степень риска предприятия с помощью вероятности наступления событий.
6. Риск как мера неопределенности ожидаемого дохода.
7. Риск как мера колеблемости дохода.
8. Математико-статистические показатели риска в терминах распределения вероятностей ожидаемого дохода и среднеквадратического отклонения от среднеожидаемого дохода.
9. Вариация, ковариация, корреляция. Среднеквадратическое отклонение от среднего наблюдавшегося дохода.
10. Положительные и отрицательные стороны статистических методов.
11. Сущность аналитических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия.
12. Игровые модели.
13. Метод анализа целесообразности затрат.
14. Методы расчета и анализа основных показателей финансово-хозяйственной деятельности предприятия.
15. Положительные и отрицательные стороны аналитических методов.
16. Дерево решений. Планирование управления рисками.
17. Современная концепция управления рисками проектов.
18. Общие требования к системам управления рисками проектов.
19. Система управления рисками и отчетность.
20. Финансовые риски и страхование.
21. Страхуемые и нестрахуемые риски.
22. Общие принципы управления риском.

23. Стратегии управления риском.
24. Личностные факторы, влияющие на степень риска при принятии управленческих решений.
25. Классификация методов управления риском.
26. Этапы управления риском (идентификация и анализ подверженности риску; анализ альтернативных методов управления риском; выбор методов управления риском; использование выбранного метода управления риском; мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском).
27. Лимитирование рисков.
28. Диверсификация. Понятие и типы.
29. Основные направления диверсификации.
30. Передача и хеджирование рисков. Общая характеристика и способы осуществления.
31. Страхование и самострахование.
32. Сравнительная оценка экономической эффективности страхования и самострахования, метод Хаустона.
33. Этапы планирования реагирования на риски.
34. Разработка плана противодействия появлению рисков и снижения их величины.
35. Методы управления рисками и выбор процедур контроля. Мониторинг и контроль рисков.
36. Балльно-весовой метод (метод оценочных карт).
37. Сценарный анализ.
38. Методы управления операционными рисками.
39. Аутсорсинг и страхование. Разработка комплексных планов по обеспечению непрерывности и восстановления финансово-хозяйственной деятельности.

Полный комплект материалов (текущего и промежуточного контроля), необходимых для оценивания результатов освоения дисциплины (модуля), хранится на кафедре-разработчике в бумажном или электронном виде.

3.3 Оценка успеваемости обучающихся

Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация по дисциплине (модулю) осуществляются в соответствии с балльно-рейтинговой системой по 100-балльной шкале. Балльные оценки для контрольных мероприятий представлены в таблице 3.2. Пересчет суммы баллов в традиционную оценку представлен в таблице 3.3.

Таблица 3.2 – Балльные оценки для контрольных мероприятий

Наименование контрольного мероприятия	Максимальный балл за 1 аттестацию	Максимальный балл за 2 аттестацию	Максимальный балл за 3 аттестацию	Всего за семестр
7 семестр				
Тестирование	8	8	10	26
Отчет по практическому занятию	7	7	10	24
Итого (максимум за период)	15	15	20	50
Экзамен	–	–	–	50
Итого	–	–	–	100

Таблица 3.3. Шкала оценки на промежуточной аттестации

Выражение в баллах	Словесное выражение при форме промежуточной аттестации - зачет	Словесное выражение при форме промежуточной аттестации – экзамен
от 86 до 100	Зачтено	Отлично
от 71 до 85	Зачтено	Хорошо
от 51 до 70	Зачтено	Удовлетворительно
до 51	Не зачтено	Не удовлетворительно

4 ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

4.1 Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

4.1.1 Основная литература

1. Антонов, Г. Д. Управление рисками организации: учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. - Москва: ИНФРА-М, 2020. - 153 с. <https://znanium.com/read?id=346774>

2. Шапкин, А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: учебник для бакалавров / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 7-е изд. - Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2019. - 880 с. <https://znanium.com/read?id=358275>

3. Уродовских, В. Н. Управление рисками предприятия: учеб. пособие / В.Н. Уродовских. - Москва: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2018. - 168 с. <https://znanium.com/read?id=302953>

4.1.2 Дополнительная литература

1. Окулов, В. Л. Риск-менеджмент: основы теории и практика применения: учебное пособие / В. Л. Окулов. - СПб: Изд-во С.-Петербур. ун-та, 2019. - 280 с. <https://znanium.com/read?id=353364>

2. Соколов, Д. В. Базисная система риск-менеджмента организаций реального сектора экономики: монография / Д.В. Соколов, А.В. Барчуков. - Москва: ИНФРА-М, 2020. - 125 с. <https://znanium.com/read?id=343302>

4.1.3 Методические материалы

– Методические указания к выполнению практических работ по дисциплине «Анализ и прогнозирование рыночных рисков»;

– Методические указания по самостоятельной работе;

– Анализ и прогнозирование рыночных рисков [Электронный курс] Доступ по логину и паролю. URL: <https://bb.kai.ru:8443/>.

4.1.4 Перечень информационных технологий и электронных ресурсов, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Организовано взаимодействие обучающегося и преподавателя с использованием электронной информационно-образовательной среды КНИТУ-КАИ.

1. Анализ и прогнозирование рыночных рисков [Электронный курс] Доступ по логину и паролю. URL: <https://bb.kai.ru:8443/>

4.1.5 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», профессиональных баз данных, информационно-справочных систем, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю)

1. Электронно-библиотечная система учебной и научной литературы «Издательство Лань». URL: <http://e.lanbook.com/>

2. Электронно-библиотечная система учебной и научной литературы «Знаниум». URL: <http://znanium.com/>.

3. Электронно-библиотечная система учебной и научной литературы «Юрайт». URL: <https://www.urait.ru/>

4. Научно-техническая библиотека КНИТУ-КАИ. URL: <https://elibs.kai.ru/>

4.2 Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля) и требуемое программное обеспечение

Описание материально-технической базы и программного обеспечения, необходимого для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю) приведено соответственно в таблицах 4.1 и 4.2.

Таблица 4.1 – Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля)

Наименование вида учебной работы	Наименование учебной аудитории, специализированной лаборатории	Перечень необходимого оборудования и технических средств обучения
Лекционные занятия	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа №206	- комплект учебной мебели; - мультимедиа-проектор; - усилитель; - экран рулонный настенный; - аудиоколонки потолочные; - радиомикрофон; - радиоприемник; - интерактивная доска; - ноутбук
Практические занятия	Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа №205	- комплект учебной мебели

Самостоятельная работа	Помещение для самостоятельной работы №104	- комплект учебной мебели; - мультимедиа-проектор; - настенный экран; - плакаты, стенды; - компьютерная техника с возможностью подключения к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду КНИТУ-КАИ
	Читальный зал научно-технической библиотеки	- комплект учебной мебели; - компьютерная техника с возможностью подключения к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду КНИТУ-КАИ

Таблица 4.2 – Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства, используемое при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю)

№ п/п	Наименование программного обеспечения	Производитель	Способ распространения (лицензионное или свободно распространяемое)
1	Blackboard	Blackboard	Лицензионное
2	– Microsoft Windows 7 или Microsoft Windows 10 (в зависимости от конфигурации компьютера),	Microsoft	Лицензионное
3	– Microsoft Office 2010 или Microsoft Office 2013 (в зависимости от конфигурации компьютера),	Microsoft	Лицензионное
4	– Kaspersky Endpoint Security 10 for Windows	Лаборатория Касперского	Лицензионное
5	Справочно-правовая система «КонсультантПлюс»	КонсультантПлюс	Лицензионное
6	Справочно-правовая система «Техэксперт»	Техэксперт	Лицензионное

5 ОСОБЕННОСТИ РЕАЛИЗАЦИИ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

Обучение по дисциплине (модулю) обучающихся с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов осуществляется с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья таких обучающихся.

Обучение лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов организуется как совместно с другими обучающимися, так и в отдельных группах.

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предусмотрены дополнительные оценочные материалы, перечень которых указан в таблице 5.1.

Таблица 5.1 – 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, контрольные работы, письменные самостоятельные работы, вопросы к промежуточной аттестации	Преимущественно письменная проверка
С нарушениями зрения	Устный опрос по терминам, собеседование по вопросам к промежуточной аттестации	Преимущественно устная проверка (индивидуально)
С нарушениями опорно-двигательного аппарата	Решение дистанционных тестов, контрольные работы, письменные самостоятельные работы, вопросы к промежуточной аттестации	Преимущественно дистанционными методами

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

- в печатной форме;
- в печатной форме с увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа;
- методом чтения задания вслух;

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.

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

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.

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

ЛИСТ РЕГИСТРАЦИИ ИЗМЕНЕНИЙ

Изменения, вносимые в рабочую программу дисциплины (модуля)

№ п/п	№ раздела внесения изменений	Дата внесения изменений	Содержание изменений	«Согласовано» заведующий кафедрой, реализующей дисциплину (модуль)