



МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Дальневосточный федеральный университет»
(ДВФУ)

ШКОЛА ЭКОНОМИКИ И МЕНЕДЖМЕНТА

СОГЛАСОВАНО
Руководитель МОП
«Международный бизнес и управление проектами»

(подпись) Д.А. Соколова
(Ф.И.О. рук. ОП)
«__» _____ 2018 г.

УТВЕРЖДАЮ
Заведующий кафедрой
Менеджмента

(подпись) Е.А. Глотова
(Ф.И.О. зав. каф.)
«__» _____ 2018 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Риск менеджмент

Специальность 38.04.02 Менеджмент,

International Business and Project Management / Международный бизнес и управление проектами (на английском языке)

Форма подготовки: очная

курс 1, семестр 1
лекции 18 час.
практические занятия 18 час.
лабораторные работы 0 час.
в том числе с использованием МАО лек. 0 /пр. 12 /лаб. 0 час.
всего часов аудиторной нагрузки 36 час.
в том числе с использованием МАО _ час.
самостоятельная работа 27 час.
в том числе на подготовку к экзамену 45 час.
контрольные работы (количество) – не предусмотрено
курсовая работа/курсовой проект – не предусмотрено
зачет семестр
экзамен 1 семестр

Рабочая программа составлена в соответствии с требованиями федерального государственного образовательного стандарта высшего образования, утвержденного приказом Министерства образования и науки РФ от 16.01.2017 № 20.

Рабочая программа обсуждена на заседании кафедры « Финансы и кредит», протокол № от «» _____ 201? г.

Заведующий кафедрой: к.э.н, доцент Лялина Ж.И.
Составители: ассистент, аспирант Лутченко В.А.

I. Рабочая программа пересмотрена на заседании кафедры:

Протокол от « ____ » _____ 201_ г. № _____

Заведующий кафедрой _____
(подпись) (И.О. Фамилия)

II. Рабочая программа пересмотрена на заседании кафедры:

Протокол от « ____ » _____ 201_ г. № _____

Заведующий кафедрой _____
(подпись) (И.О. Фамилия)

ABSTRACT

Master's degree in 38.04.02 Management / International Business and Project Management

Course title: Risk Management.

Variable part of Block 3 credits.

Instructor: Lutchenko Valeriia Alekseevna, Master degree of Economic Sciences, Assistance of Management Department.

At the beginning of the course a student should be able to:

- the ability of self-improvement and self-development in the professional field, of improvement of the cultural level;
- readiness to integrate into scientific, educational, economic, political, and cultural areas of Russia and countries of the Asia-Pacific Region;
- ability to take the initiative and make executive decisions, being aware of responsibility for the results of your professional activity;
- the ability to use modern methods and technologies (including information) in professional activities;
- the ability of self-organization and self-education;
- the ability to use normative documents in professional life, willingness to comply with the applicable laws and regulatory requirements;
- the ability to collect, store, process and evaluate the information necessary for the organization and management of professional activities (commercial, marketing, advertising, logistics, merchandising or trade and technologic); to apply the basic methods and tools for receiving, storing and processing information; to work with the computer as an information management tool;
- readiness to identify and meet the needs of the buyers of goods, their formation through marketing communications, the ability to study and predict the demand of consumers, analyze marketing information and market situation.

Learning outcomes:

Professional Competences (PC):

- (PC-2) the ability to calculate the economic and socio - economic indicators characterizing the activities of economic entities on the basis of standard methods and the current regulatory framework;

- (PC – 10) the ability to critically evaluate the proposed options for management decisions, to develop and justify proposals for their improvement, taking into account the criteria of social and economic efficiency, risks and possible socio-economic consequences;

- (PC-8) the ability to use quantitative and qualitative methods to conduct applied research and business process management, to prepare analytical materials on the results of their use;

- (PC-5) the ability to determine the development prospects of the organization based on an assessment of the company's position in the market and trends in the influence of environmental factors.

Course description.

The content of the course “Venture Capital Investments and Financial Models” consists of three sections and covers the following range of issues:

1. The concept, nature and content of risk management: the concept of risk. Risk functions (innovation function, regulating function, constructiveness and destructiveness of risk, protective function, analytical function). Sources of risk. Conditions and risk factors and their classification. Pure and speculative risks. Natural, environmental, political, transportation, industrial, financial, inflationary, systemic, selective risks, liquidity risk, credit risks, regional and sectoral risks, enterprise risk and innovation risk. The concept of risk management. Directions of risk management. Criterion for evaluating the effectiveness of risk management.
2. Risk analysis: the concept of a risk zone. Risk tolerable. Critical risk. Catastrophic risk. Risk curve. General characteristics of the methods of quantitative risk analysis. Risk factor Analog method, sensitivity analysis method, scenario analysis method, statistical test method (Monte-Carlo), expert methods.
3. Fundamentals of the theory of making risky decisions: the concept of risk decision and coefficient of variation, their calculation The main provisions of the

probabilistic approach. Making diversified decisions. Decision tree Matrix of payments. Wald criterion. Optimistic approach. Criterion Hurwitz. Bayes-Laplace and Laplace criteria. Matrix of lost profits. The criterion of loss of benefit Savage. Operational Risk Management. Credit Risk Management. Consolidation and risk grouping. Diversification. Risk sharing Standards for building a risk management system: COSO, FERMA, ISO / IEC. Development of the management system of the organization.

Main course literature:

1. Risk management: textbook / Fomichev A.N., - 4th ed. - M.: Dashkov and Co., 2016. - 372 p. ISBN 978-5-394-02676-8 - Access Mode: <http://znanium.com/catalog/product/937403>.

2. Tsibulnikova V.E. Risk management in education [Electronic resource]: educational and methodical complex of the discipline / Tsibulnikova VE - Electron. text data.— M .: Moscow Pedagogical State University, 2016. — 36 p.— Access mode: <http://www.iprbookshop.ru/72529.html>.— EBS “IPRbooks”.

Form of final control: exam.

Аннотация к рабочей программе дисциплины

Risk Management (Риск менеджмент)

Учебный курс «Risk Management (Риск менеджмент)» предназначен для студентов направления подготовки 38.04.02 Менеджмент, магистерская программа «International Business and Project Management / Международный бизнес и управление проектами (на английском языке)».

Дисциплина «Risk Management (Риск менеджмент)» включена в состав дисциплин по выбору вариативной части блока «Дисциплины (модули).

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы, 108 часа. Учебным планом предусмотрены аудиторные лекционные занятия (18 часов), практические занятия (18 часов, в том числе МАО 12 часов), самостоятельная работа студентов (27 часов), в том числе на подготовку к экзамену 45 часов. Дисциплина реализуется на 1 курсе в 1 семестре.

Дисциплина «Risk Management (Риск менеджмент)» основывается на знаниях дисциплины «Экономика и управление: адаптационный курс», «Стратегический менеджмент», «Теория международных отношений», «Управление проектами», «Теория организации и организационное поведение», «Управленческая экономика», «Маркетинговое управление», «Менеджмент качества при создании инновационных продуктов», «Венчурные инвестиции и финансовые модели», «Предпринимательство» и позволяет подготовить студента к освоению ряда таких дисциплин, как «Эконометрика», «Ведение бизнеса в Азии», «Операционный менеджмент и эффективность бизнеса», «Бизнес-планирование»; к прохождению учебной и производственной практик.

Содержание дисциплины состоит из трех разделов и охватывает следующий круг вопросов:

1. Понятие, сущность и содержание риск менеджмента: понятие риска. Функции риска (инновационная функция, регулирующая функция, конструктивность и деструктивность риска, защитная функция, аналитическая функция). Источники рисков. Условия и факторы рисков и их

классификация. Чистые и спекулятивные риски. Природные, экологические, политические, транспортные, производственные, финансовые, инфляционные, системные, селективные риски, риск ликвидности, кредитные риски, региональный и отраслевой риски, риск предприятия и инновационный риск. Понятие риск-менеджмента. Направления управления рисками. Критерий оценки эффективности риск-менеджмента.

2. Анализ рисков: понятие зоны риска. Допустимый риск. Критический риск. Катастрофический риск. Кривая риска. Общая характеристика методов количественного анализа рисков. Коэффициент риска. Метод аналогий, метод анализа чувствительности, метод анализа сценариев, метод статистических испытаний (Монте-Карло), экспертные методы.

3. Основы теории принятия рискованных решений: понятие риска решения и коэффициента вариации, их расчет. Основные положения вероятностного подхода. Принятие диверсифицированных решений. Дерево решений. Матрица платежей. Критерий Вальда. Оптимистический подход. Критерий Гурвица. Критерии Байеса-Лапласа и Лапласа. Матрица упущенной выгоды. Критерий упущенной выгоды Сэвиджа. Управление операционными рисками. Управление кредитными рисками. Объединение и группирование рисков. Диверсификация. Распределение рисков. Стандарты построения системы управления рисками: COSO, FERMA, ИСО/МЭК. Разработка системы управления организацией.

Цель – формирование у студентов представления о возможностях применения знаний, полученных из других курсов, на основе анализа практики и понимания реальностей, с которыми сталкивается российская высокотехнологическая компания при решении задач и принятии рискованных решений. Получение студентами теоретических знаний в области анализа рисков, принятия рискованных решений, применения методов уменьшения и управления рисками, а также разработки систем управления рисками на предприятии в соответствии с существующими стандартами.

Задачи:

- приобретение студентами знаний по организации процесса анализа рисков;
- освоение подходов и формальных методов разработки управленческих решений в условиях неопределенности и риска;
- получение знаний в области разработки и реализации систем мониторинга и управления рисками.

Для успешного изучения дисциплины «Риск менеджмент» у обучающихся должны быть сформированы следующие предварительные компетенции:

- способность творчески воспринимать и использовать достижения науки, техники в профессиональной сфере в соответствии потребностями регионального и мирового рынка труда;
- способность использовать современные методы и технологии (в том числе информационные) в профессиональной деятельности.
- готовность интегрироваться в научное, образовательное, экономическое, политическое и культурное пространство России и АТР;
- умение пользоваться нормативными документами в своей профессиональной деятельности, готовность к соблюдению действующего законодательства и требований нормативных документов;
- способность осуществлять сбор, хранение, обработку и оценку информации, необходимой для организации и управления профессиональной деятельностью (коммерческой, маркетинговой, рекламной, логистической, товароведной, и (или) торгово-технологической); применять основные методы и средства получения, хранения, переработки информации и работать с компьютером как со средством управления информацией;
- способность к логическому мышлению, анализу, систематизации, обобщению, критическому осмыслению информации, постановке исследовательских задач и выбору путей их решения.

В результате изучения данной дисциплины у обучающихся формируются следующие профессиональные компетенции:

Код и формулировка компетенции	Этапы формирования компетенции	
ПК-2 способность на основе типовых методик и действующей нормативно – правовой базы рассчитать экономические и социально – экономические показатели, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.	Знает	Типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.
	Умеет	Использовать на практике типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.
	Владеет	Типовыми методиками и действующей нормативно-правовой базой расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.
ПК – 10 способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений, разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально – экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	Знает	Методы оценки вариантов управленческих решений в условиях неопределенности и риска.
	Умеет	Разрабатывать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев социально – экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий
	Владеет	Методиками оценки социально-экономических последствий решений, принятых в условиях неопределенности и риска.
ПК-8 способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения	знает	методы сбора и анализа исходных данных для расчета экономических и социально-экономических показателей;
	умеет	проводить расчеты экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов;
	владеет	методикой проведения анализа результатов расчетов экономических и социально-экономических показателей;
ПК-5 способность определения перспектив развития организации на основе оценки положения компании на рынке и тенденции влияния факторов внешней среды	Знает	Основы анализа внешней среды
	Умеет	Находить решения стандартных задач в профессиональной деятельности с учетом основ инновационного менеджмента
	Владеет	Способностью решать различные задачи профессиональной деятельности с учетом основных современных социально-экономических требований внешней среды;

		методами учета неопределенности и риска в проектах, а также методами оценки эффективности проекта
--	--	---------------------------------------------------------------------------------------------------

Для формирования вышеуказанных компетенций в рамках дисциплины «Risk Management (Риск менеджмент)» применяются следующие методы активного/ интерактивного обучения:

- практическое занятие - разбор конкретных ситуаций;
- семинар – дискуссия, с презентациями;
- кейсы.

I. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ТЕОРЕТИЧЕСКОЙ ЧАСТИ КУРСА

Лекции (18 часов)

Раздел I. Понятие, сущность и содержание риск-менеджмента (4 час.)

Тема 1. Понятие риска и функции риска (1 час.)

Понятие риска. Функции риска (инновационная функция, регулирующая функция, конструктивность и деструктивность риска, защитная функция, аналитическая функция).

Тема 2. Причины возникновения рисков (1 час.)

Источники рисков. Условия и факторы рисков и их классификация.

Тема 3. Классификация рисков (1 час.)

Чистые и спекулятивные риски. Природные, экологические, политические, транспортные, производственные, финансовые, инфляционные, системные, селективные риски, риск ликвидности, кредитные риски, региональный и отраслевой риски, риск предприятия и инновационный риск.

Тема 4. Цель и задачи риск-менеджмента. (1 час.)

Понятие риск-менеджмента. Направления управления рисками. Критерий оценки эффективности риск-менеджмента.

Раздел 2. Анализ рисков (6час.)

Тема 5. Качественный анализ рисков (2 час.)

Понятие зоны риска. Допустимый риск. Критический риск. Катастрофический риск. Кривая риска.

Тема 6. Количественные методы анализа рисков (4 час.)

Общая характеристика методов количественного анализа рисков. Коэффициент риска. Метод аналогий, метод анализа чувствительности, метод анализа сценариев, метод статистических испытаний (Монте-Карло), экспертные методы.

Раздел 3. Основы теории принятия рискованных решений (8 час.)

Тема 7. Вероятностная постановка принятия предпочтительных решений (2 час.)

Понятие риска решения и коэффициента вариации, их расчет. Основные положения вероятностного подхода. Принятие диверсифицированных решений. Дерево решений

Тема 8. Методы теории игр (2 час.).

Матрица платежей. Критерий Вальда. Оптимистический подход. Критерий Гурвица. Критерии Байеса-Лапласа и Лапласа. Матрица упущенной выгоды. Критерий упущенной выгоды Сэвиджа.

Тема 9. Методы уменьшения риска. (2 час.) Управление операционными рисками. Управление кредитными рисками. Объединение и группирование рисков. Диверсификация. Распределение рисков.

Тема 10. Система управления рисками (2 час.) Стандарты построения системы управления рисками: COSO, FERMA, ИСО/МЭК. Разработка системы управления организации.

II. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ТЕОРЕТИЧЕСКОЙ ЧАСТИ КУРСА

Практические занятия

(18 час., в том числе 12 час. с использованием методов активного обучения (МАО))

Практическое занятие № 1-2. Дерево решений. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (4 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие № 3-4. Методы теории игр. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (2 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие № 5-6. Вероятностные методы принятия предпочтительных решений. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (2 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие № 7-8. Методы уменьшения рисков. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (2 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие № 9-10. Стандарты систем управления рисками. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (2 час.)

Решение ситуационных задач.

III. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине «Риск менеджмент» представлено в Приложении 1 и включает в себя:

- план-график выполнения самостоятельной работы по дисциплине, в том числе примерные нормы времени на выполнение заданий;
- характеристика заданий для самостоятельной работы обучающихся и методические рекомендации по их выполнению;
- требования к представлению и оформлению результатов самостоятельной работы;
- критерии оценки выполнения самостоятельной работы.

IV. КОНТРОЛЬ ДОСТИЖЕНИЯ ЦЕЛЕЙ КУРСА

№ п/п	Контролируемые разделы / темы дисциплины	Коды и этапы формирования компетенций		Оценочные средства	
				текущий контроль	промежуточная аттестация
1	Раздел I. Понятие, сущность и содержание риск-менеджмента	ПК-2	Типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
			Использовать на практике типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
			Типовыми методиками и действующей нормативно-правовой базой расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
		ПК - 10	Методы оценки вариантов управленческих решений в условиях неопределенности и риска.	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
			Разрабатывать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев социально – экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
			Методиками оценки социально-экономических последствий решений, принятых в условиях неопределенности и риска.	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
	Раздел II. Анализ рисков	ПК - 8	методы сбора и анализа исходных данных для расчета экономических и социально-экономических показателей;	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
			проводить расчеты экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов;	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
			методикой проведения анализа результатов расчетов	решение практических заданий;	Вопросы к экзамену 1-12.

			экономических и социально-экономических показателей;	ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	
Раздел III. Основы теории принятия рискованных решений	ПК - 5	Основы анализа внешней среды		решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
		Находить решения стандартных задач в профессиональной деятельности с учетом основ инновационного менеджмента		решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
		Способностью решать различные задачи профессиональной деятельности с учетом основных современных социально-экономических требований внешней среды; методами учета неопределенности и риска в проектах, а также методами оценки эффективности проекта		решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.

Текущий контроль. Предусматривает учет посещения студентами занятий в течении периода обучения и оценку своевременности и качества выполнения студентами практических заданий и самостоятельных работ.

Пример практических заданий и типовые задания для самостоятельной работы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений и навыков и (или) опыта деятельности, а также критерии и показатели, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и характеризующие этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы представлены в Приложении 2.

Итоговый контроль. Предусматривает рейтинговую оценку по учебной дисциплине в течении семестра в процессе обучения.

IV. СПИСОК УЧЕБНОЙ ЛИТЕРАТУРЫ И ИНФОРМАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература

(электронные издания)

1. **Риск-менеджмент:** Учебное пособие / Фомичев А.Н., - 4-е изд. - М.: Дашков и К, 2016. - 372 с. ISBN 978-5-394-02676-8 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/937403>
2. Цибульникова В.Е. Риск-менеджмент в образовании [Электронный ресурс]: учебно-методический комплекс дисциплины/ Цибульникова В.Е.— Электрон. текстовые данные.— М.: Московский педагогический государственный университет, 2016.— 36 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/72529.html>.— ЭБС «IPRbooks»

Дополнительная литература:

(печатные и электронные издания)

1. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: Учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / Под ред. Грачева М.В. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2015. - 544 с.: 60x90 1/16 ISBN 978-5-238-01506-4 - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/882522>
2. Пасько Е.А. Риск-менеджмент в корпоративном бизнесе [Электронный ресурс]: курс лекций на английском языке/ Пасько Е.А.— Электрон. текстовые данные.— Ставрополь: Северо-Кавказский федеральный университет, 2016.— 110 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/69431.html>.— ЭБС «IPRbooks»
3. Риск-менеджмент — основа устойчивости бизнеса : учеб. пособие / А. Н. Ряховская, О. Г. Крюкова, М. О. Кузнецова; под ред. О. Г. Крюковой. — М.: Магистр: ИНФРА-М, 2018. — 256с. - Режим доступа: <http://znanium.com/catalog/product/975577>

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети

«Интернет»

1. Freedom Collection на портале ScienceDirect
<http://www.sciencedirect.com/>
2. Электронная библиотека и базы данных ДВФУ .
<http://dvfu.ru/web/library/elib>
3. Электронно-библиотечная система «Научно-издательского центра ИНФРА-М» <http://znanium.com>

4. Электронно-библиотечная система Российской государственной библиотеки им.Ленина. <http://www.rgb.ru>
5. Научная библиотека КиберЛенинка: <http://cyberleninka.ru/>
6. Angel Capital Association – Connections and ideals that drive returns. <http://angelcapitalassociation.org>
7. McKinsey&Company. <http://www.mckinseyquarterly.com>

Перечень информационных технологий и программного обеспечения

1. Microsoft Word
2. Microsoft Excel
3. Microsoft PowerPoint
4. Microsoft Publisher
5. КонсультантПлюс / Гарант
6. Microsoft Internet Explorer/ Mozilla Firefox/ Opera

V. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Описание последовательности действий обучающихся (алгоритм изучения дисциплины)

Начиная изучение дисциплины «Риск менеджмент», студенту необходимо:

- ознакомиться с программой, изучить список рекомендуемой литературы; к программе курса необходимо будет возвращаться постоянно, по мере усвоения каждой темы в отдельности, для того чтобы понять: достаточно ли полно изучены все вопросы;
- внимательно разобраться в структуре дисциплины «Риск менеджмент», в системе распределения учебного материала по видам

занятий, формам контроля, чтобы иметь представление о практической части всего курса изучения;

- обратиться к электронным источникам, согласно учебному курсу по дисциплине «Риск менеджмент», позволяющим ориентироваться в последовательности выполнения заданий.

При подготовке к занятиям по дисциплине «Риск менеджмент» необходимо руководствоваться нормами времени на выполнение заданий. Например, при подготовке к занятию на проработку конспекта одной лекции, учебников, как правило, отводится от 0,5 часа до 2 часов, а на изучение первоисточников объемом 16 страниц печатного текста с составлением конспекта 1,5–2 часа, с составлением лишь плана около 1 часа.

Рекомендации по работе с литературой

Наиболее предпочтительна последовательность в работе с литературой. Ее можно представить в виде следующего примерного алгоритма:

- ознакомление с рабочей учебной программой и учебно-методическим комплексом дисциплины;
- изучение основной учебной литературы;
- проработка дополнительной (учебной и научной) литературы.

Для глубокого понимания сути темы, изложенной в рамках практического материала, рекомендуется затрачивать на прочтение основной и дополнительной литературы не менее 2 часов в неделю. В качестве поощрения студенты могут получать дополнительные баллы по самостоятельной работе с литературой: поиск литературы по заданной теме, сравнительный анализ научных публикаций, подготовка доклада и участие в научных конференциях. Основная литература подлежит обязательному изучению. Для подготовки к занятиям, текущей и промежуточной аттестации студенты могут воспользоваться электронной библиотекой ДВФУ, расположенной по адресу <http://www.dvfu.ru/library/electronic-resources/>, где они имеют возможность получить доступ к учебно-методическим

материалам, как библиотеки вуза, так и иных электронных библиотечных систем. В свою очередь студенты могут взять необходимую литературу на абонементе вузовской библиотеки, а также воспользоваться читальными залами вуза.

В ходе чтения очень полезно, хотя и не обязательно, делать краткие конспекты прочитанного, выписки, заметки, выделять неясные, сложные для восприятия вопросы. В целях прояснения последних нужно обращаться к преподавателю. По завершении изучения рекомендуемой литературы полезно проверить уровень своих знаний с помощью контрольных вопросов для самопроверки.

Настоятельно рекомендуется избегать механического заучивания учебного материала. Практика убедительно показывает: самым эффективным способом является не «зубрежка», а глубокое, творческое, самостоятельное проникновение в существо изучаемых вопросов.

Необходимо вести систематическую каждодневную работу над литературными источниками. Объем информации по курсу настолько обширен, что им не удастся овладеть в «последние дни» перед сессией, как на это иногда рассчитывают некоторые студенты.

Следует воспитывать в себе установку на прочность, долговременность усвоения знаний по курсу. Надо помнить, что они потребуются не только и не столько в ходе курсового экзамена, но – что особенно важно – в последующей профессиональной деятельности.

Литература имеется в библиотеке университета.

Студент обязан знать не только рекомендуемую литературу, но и новые, существенно важные издания по курсу, вышедшие в свет после его публикации.

***Рекомендации по подготовке для сдачи экзамена согласно
рейтинговой системе ДВФУ к экзамену***

Реализация дисциплины «Риск менеджмент» предусматривает следующие виды учебной работы: практические занятия, самостоятельную работу студентов, текущий контроль и промежуточную аттестацию.

Освоение курса дисциплины «Риск менеджмент» предполагает рейтинговую систему оценки знаний студентов и предусматривает со стороны преподавателя текущий контроль за посещением студентами практических занятий, подготовкой и выполнением всех видов самостоятельной работы.

Промежуточной аттестацией по дисциплине «Риск менеджмент» является экзамен, который проводится в виде устного опроса по вопросам.

В течение учебного семестра обучающимся нужно:

- освоить теоретический материал (20 баллов);
- успешно выполнить аудиторные и контрольные задания (50 баллов);
- своевременно и успешно выполнить все виды самостоятельной работы (30 баллов).

Студент считается аттестованным по дисциплине «Риск менеджмент» при условии выполнения всех видов текущего контроля и самостоятельной работы, предусмотренных учебной программой.

Критерии оценки по дисциплине «Риск менеджмент» для аттестации на экзамене следующие: 86-100 баллов – «отлично», 76-85 баллов – «хорошо», 61-75 баллов – «удовлетворительно», 60 и менее баллов – «неудовлетворительно».

Пересчет баллов по текущему контролю и самостоятельной работе производится по формуле:

$$P(n) = \sum_{i=1}^m \left[\frac{O_i}{O_i^{max}} \times \frac{k_i}{W} \right],$$

где: $W = \sum_{i=1}^n k_i^n$ для текущего рейтинга;

$W = \sum_{i=1}^m k_i^n$ для итогового рейтинга;

$P(n)$ – рейтинг студента;

m – общее количество контрольных мероприятий;

n – количество проведенных контрольных мероприятий;

O_i – балл, полученный студентом на i -ом контрольном мероприятии;

O_i^{max} – максимально возможный балл студента по i -му контрольному мероприятию;

k_i – весовой коэффициент i -го контрольного мероприятия;

k_i^n – весовой коэффициент i -го контрольного мероприятия, если оно является основным, или 0, если оно является дополнительным.

Рекомендации по планированию и организации времени, отведенного на изучение дисциплины

Планирование – важнейшая черта человеческой деятельности, один из характерных, обязательных признаков человеческого труда. Для организации сложной учебной деятельности очень эффективным является использование средств, напоминающих о стоящих перед нами задачах, их последовательности выполнения. Такими средствами могут быть мобильный телефон, имеющий программу органайзера, включающего будильник, календарь и список дел; таймеры, напоминающие о выполнении заданий по дисциплине; компьютерные программы составления списка дел, выделяющие срочные и важные дела.

Составление списка дел – первый шаг к организации времени. Список имеет то преимущество, что позволяет видеть всю картину в целом. Упорядочение, классификация дел в списке – второй шаг к организации времени.

Регулярность – первое условие поисков более эффективных способов работы. Рекомендуется выбрать один день недели для регулярной подготовки по дисциплине. Регулярность не просто позволяет подготовиться к делу, она создает настрой на это дело, позволяет выработать правила выполнения дела (например, сначала проработка материала практических

занятий, учебника, чтение первоисточника, затем выделение и фиксирование основных идей в тетради).

Чтобы облегчить выполнение заданий, необходимо определить временные рамки. Еженедельная подготовка по дисциплине «Риск менеджмент» требует временных затрат. Четкое фиксирование по времени регулярных дел, закрепление за ними одних и тех же часов – важный шаг к организации времени. При учете времени надо помнить об основной цели рационализации – получить наибольший эффект с наименьшими затратами. Учет – лишь средство для решения основной задачи: сэкономить время.

Написание конспекта практических занятий: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; помечать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на семинарском занятии

Для подготовки к практическому занятию необходима проработка рабочей программы, уделяя особое внимание целям и задачам структуре и содержанию дисциплины. Конспектирование источников. Работа с конспектом практических занятий, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы, работа с текстом.

Важная роль в организации учебной деятельности отводится программе дисциплины, дающая представление не только о тематической последовательности изучения курса, но и о затратах времени, отводимом на изучение курса. Успешность освоения дисциплины во многом зависит от правильно спланированного времени при самостоятельной подготовке (в зависимости от специальности от 2 – 3 до 5 часов в неделю).

VI. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для проведения практических занятий необходима аудитория, оснащенная мультимедийным проектором.

Для проведения лабораторных занятий - аудитория, оснащенная мультимедийным проектором, персональными компьютерами на рабочих местах студентов с выходом в Интернет и установленным программным обеспечением (как минимум – Microsoft Office, Консультант Плюс / Гарант).



МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное
учреждение высшего образования
«Дальневосточный федеральный университет»
(ДВФУ)

ШКОЛА ЭКОНОМИКИ И МЕНЕДЖМЕНТА

**УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ
САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ ОБУЧАЮЩИХСЯ**

по дисциплине «Риск менеджмент»

38.04.02 «Менеджмент»

**International Business and Project Management / Международный бизнес и
управление проектами (на английском языке)**

Форма подготовки: очная

**Владивосток
2018**

I. План-график выполнения самостоятельной работы по дисциплине

№ п/п	Дата / сроки выполнения	Вид самостоятельной работы	Примерные нормы времени на выполнение	Форма контроля
1.	В течение семестра	Выполнение практических заданий	17	Проверка наличия дополнительных материалов, файлов, выполнение заданий и их защита
2.	В течение семестра	Подготовка группового доклада	10	Проверка наличия материала практических занятий, файлов, выполнение заданий и их защита, активное участие в обсуждении вопросов по темам докладов.
3.	4 неделя	Подготовка к экзамену	45	Устный опрос
	6 неделя			
	9 неделя			
	12 неделя			
	15 неделя			
	18 неделя			
ИТОГО			72	

II. Характеристика заданий для самостоятельной работы обучающихся, методические рекомендации по их выполнению

Рекомендации по самостоятельной работе студентов

Особое значение для освоения теоретического материала и для приобретения и формирования умений и навыков имеет самостоятельная работа студентов.

Самостоятельная работа студентов по дисциплине «Риск-менеджмент» предусматривает изучение рекомендуемой основной и дополнительной литературы, решение практических заданий, подготовку к выполнению и защите групповых докладов и промежуточной аттестации – экзамену.

Темы и ориентировочное содержание аналитических, научно-исследовательских и творческих заданий

Задание 1. Выполнение практических заданий.

Примеры практических задач

Задача 1. Предприятие разработало новый товар. Стоимость производства товара – 2,5 млн. руб. Для организации производства потребуется год, однако вероятность того, что будет обеспечена необходимая безопасность технологического процесса, составляет 0,55. В связи с этим встает вопрос о разработке компьютерной контролирующей системы (ККС), которая обеспечит безопасность. Исследования по её созданию продлятся год и будут стоить 1 млн. руб. При этом вероятность успешного создания ККС – 0,75. Разработку ККС можно начать либо немедленно, либо подождать год до выяснения безопасности технологического процесса. В случае, если продажа нового товара начнется через год, то доход составит 10 млн. руб. Если отложить выпуск товара на год, то доход упадет до 8,5 руб. из-за возможного появления конкурентов. Необходимо:

- 1) построить дерево решений;
- 2) принять решение;
- 3) выяснить, как должна измениться вероятность успешной разработки ККС, чтобы изменилось решение.

Задача 2. Химическая фирма выпускает промышленный растворитель, срок хранения которого не превышает 1 мес. Объем выпуска продукции планируется вначале каждого месяца. Известно ежемесячный спрос может находиться в пределах от 10 до 20 т. Стоимость производства тонны растворителя – 40000 р., цена, по которой продается тонна растворителя – 60000 р. Для удобства рассматривают: низкий спрос 10 т /мес., вероятность которого составляет 0,3; средний – 15 т /мес. с вероятностью 0,6 и высокий 20 т /мес. с вероятностью 0,1. Необходимо:

- 1) построить дерево решений;

2) принять решение.

Задача 3. В консалтинговую фирму обратился клиент с просьбой рассмотреть варианты инвестирования 1 млн. руб. сроком на два года. В результате маркетингового исследования были предложены два варианта – А и Б, один из которых содержит небольшой риск, второй без риска. Вариант А предусматривает несколько возможных размеров прибыли: 8%, 10%, 12%. Из-за особенностей инвестируемого объекта существует связь доходов первого и второго годов.

Первый год	Второй год		
	8%	10%	12%
8%	0,6	0,3	0,1
10%	0,2	0,5	0,3
12%	0,1	0,2	0,7

На первом этапе все три варианта прибыли равновероятны. Вариант Б предусматривает стабильную прибыль 9,5% годовых. Необходимо:

- 1) построить дерево решений;
- 2) выбрать вариант инвестирования;
- 3) выяснить, как изменится дерево решений, если станет возможным перейти от одного варианта к другому в конце первого года.

Задача 4. Компания собирается производить новый товар, для чего необходимо построить новый завод. Существует три варианта:

1. Построить завод стоимостью 60 млн. руб. При этом возможен большой спрос с вероятностью 0,7 и низкий с вероятностью 0,3. Если спрос большой, то ожидается годовой доход в размере 25 млн. руб. в течение следующих пяти лет; если спрос низкий, то ежегодные убытки – 5 млн. руб.

2. Построить маленький завод стоимостью 35 млн. руб. Здесь также возможен большой и маленький спрос с теми же вероятностями. При

большом спросе ежегодный доход в течение пяти лет – 15 млн. руб., при низком – 2,5 млн. руб.

3. Сразу завод не строить, а отложить решение на один год для сбора дополнительной информации, которая может быть позитивной и негативной с вероятностями 0,8 и 0,2 соответственно. Через год, если информация окажется позитивной можно построить большой или маленький завод по указанным выше ценам. Руководство компании может решить никакого завода не строить, если информация будет негативной. Вне зависимости от типа завода вероятности большого и низкого спроса меняются на 0,9 и 0,1 соответственно, если будет получена позитивная информация. Доходы за последующие четыре года остаются такими же, какими они были в 1 и 2 вариантах. Необходимо:

- 1) построить дерево решений, учитывающее все возможности;
- 2) определить наиболее эффективную последовательность действий;
- 3) предположим, что строительная компания предложит фирме скидку, если она сразу приступит к строительству большого завода. Какова должна быть величина этой скидки (в процентах), чтобы компания отказалась от ранее выбранного варианта?

Критерии оценки:

- 100-86 баллов выставляется студенту, если студент выразил свое мнение по сформулированной проблеме, аргументировал его, точно определив ее содержание и составляющие. Приведены данные нормативных и технических документов. Студент знает и владеет навыком самостоятельной исследовательской работы по теме исследования; методами и приемами анализа теоретических и/или практических аспектов изучаемой области. Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет; графически работа оформлена правильно;

- 85-76 баллов – работа характеризуется смысловой цельностью, связностью и последовательностью изложения; допущено не более 1 ошибки при объяснении смысла или содержания проблемы. Для аргументации приводятся данные нормативных и технических документов.

Продемонстрированы исследовательские умения и навыки. Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет. Допущены одна-две ошибки в оформлении работы;

- 75-61 балл – студент проводит достаточно самостоятельный анализ основных этапов и смысловых составляющих проблемы; понимает базовые основы и теоретическое обоснование выбранной темы. Привлечены нормативные и технические документы. Допущено не более 2 ошибок в смысле или содержании проблемы, оформлении работы;

- 60-50 баллов – если работа представляет собой полностью переписанный исходный текст, без каких бы то ни было комментариев, анализа. Не раскрыта структура и теоретическая составляющая темы. Допущено три или более трех ошибок в смысловом содержании раскрываемой проблемы, в оформлении работы.

Задание 2. На основании изучения литературы, рекомендованной преподавателем, подготовить групповой доклад на одну из тем, связанных с риск менеджментом и представить презентацию на выбранную тему.

Методические указания для выполнения самостоятельной работы по заданию 2: «Доклад на выбранную тему».

Темы для раскрытия в первой части домашнего задания.

1. Основные аксиомы риск-менеджмента.
2. Законы управления рисками.
3. Принципы риск-менеджмента.
4. Понятие и сущность процессного подхода. Технология управления.
5. Внешний и внутренний мониторинг рисков.
6. Планирование в системе риск-менеджмента.
7. Мотивирование как функция риск-менеджмента.
8. Учет и контроль в системе управления рисками.
9. Оценка эффективности управления рисками.

10. Понятие и виды методов управления рисками.
11. Юридические методы управления рисками.
12. Административные методы риск-менеджмента.
13. Экономические методы управления рисками.
14. Понятие и содержание социальных методов управления.
15. Психологические методы управления рисками.
16. Производственные методы риск-менеджмента.
17. Роль научно-прикладных методов управления в риск-менеджменте.

Используя учебную литературу, научные публикации и интернет-ресурсы, осуществить поиск информации по выбранной тематике. Изучить теоретические материалы, мнение экспертов.

Обсудить в своей группе отобранные материалы по выбранной тематике, коллективно разработать план ее изложения перед студенческой аудиторией. Распределить в группе задания, обязанности по доработке темы в соответствие с разработанным планом (например, осуществить поиск недостающих фактических данных, нормативно-законодательных актов, примеров).

Подготовить презентацию и файл в процессоре MS Word с сопроводительным текстом к каждому слайду.

Осуществить поиск правовых документов по теме в справочно-правовой системе Консультант Плюс, сформировать папку с отобранными нормативно-законодательными актами, подготовить закладки на нужные фрагменты текста в документах.

Рекомендации по работе с литературой

При самостоятельной работе с рекомендуемой литературой студентам необходимо придерживаться определенной последовательности:

- при выборе литературного источника теоретического материала лучше всего исходить из основных понятий изучаемой темы курса, чтобы

точно знать, что конкретно искать в том или ином издании;

- для более глубокого усвоения и понимания материала следует читать не только имеющиеся в тексте определения и понятия, но и конкретные примеры;

- чтобы получить более объемные и системные представления по рассматриваемой теме необходимо просмотреть несколько литературных источников (возможно альтернативных);

- не следует конспектировать весь текст по рассматриваемой теме, так как такой подход не дает возможности осознать материал; необходимо выделить и законспектировать только основные положения, определения и понятия, позволяющие выстроить логику ответа на изучаемые вопросы.

Методические рекомендации по подготовке презентации

1. Первый слайд должен содержать название доклада, ФИО и координаты (номер группы, направление подготовки, адрес электронной почты) выступающего. Каждый слайд должен иметь заголовок.

2. Презентация начинается с аннотации, где на одном-двух слайдах дается представление, о чем пойдет речь. Большая часть презентаций требует оглашения структуры.

3. Переход от слайда к слайду организуйте по щелчку мыши. Оптимальная скорость переключения – один слайд за 1–2 минуты. Слушатели должны успеть воспринять информацию и визуально со слайда, и на слух. «Универсальная» оценка – число слайдов равно продолжительности выступления в минутах.

4. Размер шрифта основного текста – не менее 16pt, заголовки ≥ 20 pt. Наиболее читабельным и традиционно используемым в научных исследованиях является Times New Roman. Оформляйте все слайды в едином стиле.

5. Презентация является дополнением к докладу. Каждый слайд – «плакат», поэтому должен содержать таблицы с фактическими данными и

диаграммы (с обязательным указанием ссылок на источники в случае, если они подготовлены самостоятельно), информацию в виде схем и рисунков. Сопроводительный текст к каждому слайду сохраните либо в разделе Заметки, либо в файле MS Word.

6. Не перегружайте слайд информацией. Не делайте много мелкого текста. При подготовке презентации рекомендуется в максимальной степени использовать графики, схемы, диаграммы и модели с их кратким описанием. Фотографии и рисунки делают представляемую информацию более интересной и помогают удерживать внимание аудитории, давая возможность ясно понять суть предмета. Длинные перечисления или большие таблицы с числами тяжело воспринимаются, лучше построить графики.

7. Имеет смысл быть аккуратным. Неряшливо сделанные слайды (разнобой в шрифтах и отступах, ошибки и опечатки) вызывают подозрение, что и к содержательным вопросам докладчик подошёл «спустя рукава». Готовую презентацию надо просмотреть внимательно несколько раз «свежим» взглядом для выявления проблем с оформлением и опечаток.

8. Если Вы чувствуете себя хоть немного неуверенно перед аудиторией, или выступление очень ответственное, то напишите и выучите свою речь наизусть. Озвучивание одной страницы (формат А4, шрифт 14pt, полуторный интервал) занимает 2 минуты. Потренируйтесь выступать с вашей презентацией. Пусть кто-то послушает и скажет Ваши ошибки, впечатление о выступлении, что интересно, что непонятно, как Вы выглядели.

9. Следите за временем (регламент выступления – 10-15 минут).

10. Речь и слайды не должны совпадать, тогда презентация станет «объёмной». Стил ь речи должен быть понятным для аудитории, используйте примеры, ассоциации и образы. Слайды могут содержать больше «технических» подробностей: формулы, схемы, таблицы, графики. Всегда подписывайте оси (какая переменная и ее размерность).

11. Первые же фразы должны интриговать. Например, можно сказать о том, насколько сложной или насколько важной является данная задача, или о том, насколько неожиданным будет решение – это позволит удержать внимание слушателей до конца. Но тогда концовка действительно должна оказаться нетривиальной – иначе слушатель будет разочарован. Запомните, у Вас только 20 секунд в начале доклада для того, чтобы привлечь внимание слушателей. Если за это время не прозвучит нечто поистине интригующее (или хотя бы хорошая шутка), вернуть внимание будет очень сложно.

12. Люди лучше запоминают то, что увидели последним!

13. В серьёзных научных презентациях не следует использовать эффекты анимации и излишнее «украшательство».

14. Заранее продумайте возможные проблемы с техникой. Заранее скопируйте на рабочий стол файл с презентацией и проверьте, как он работает, с первого до последнего слайда. Обязательно имейте при себе копию презентации на флэш-карте. Проверьте, нет ли проблем с отображением русских шрифтов и формул.

Критерии оценки выполнения коллективного научно-исследовательского, творческого задания

№ п/п	Критерий	Количество баллов
1	Готовность результатов самостоятельной работы в срок	10
2	Доклад с демонстрацией презентации, ответы на вопросы аудитории	20
3	Материал современный, актуальный, интересный для аудитории	25
4	Тема раскрыта глубоко, изложение материала логично, аргументированно, подкреплено иллюстрациями, таблицами и диаграммами с фактическими данными, схемами и рисунками	25
5	Наличие папки с нормативно-законодательными актами, закладками в СПС Консультант Плюс, презентации и файла MS Word с текстовым материалом	20
	ИТОГО	100



МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное автономное образовательное
учреждение высшего образования

**«Дальневосточный федеральный университет»
(ДФУ)**

ШКОЛА ЭКОНОМИКИ И МЕНЕДЖМЕНТА

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

по дисциплине «Риск-менеджмент»

Специальность 38.04.02 «Менеджмент»

**International Business and Project Management / Международный бизнес и
управление проектами (на английском языке)**

Форма подготовки: очная

**Владивосток
2018**

**Паспорт
фонда оценочных средств
по дисциплине «Риск менеджмент»**

Код и формулировка компетенции	Этапы формирования компетенции	
ПК-2 способность на основе типовых методик и действующей нормативно – правовой базы рассчитать экономические и социально – экономические показатели, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.	Знает	Типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.
	Умеет	Использовать на практике типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.
	Владеет	Типовыми методиками и действующей нормативно-правовой базой расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.
ПК 10 – способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений, разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально – экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	Знает	Методы оценки вариантов управленческих решений в условиях неопределенности и риска.
	Умеет	Разрабатывать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев социально – экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий
	Владеет	Методиками оценки социально-экономических последствий решений, принятых в условиях неопределенности и риска.
ПК-8 способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения	знает	методы сбора и анализа исходных данных для расчета экономических и социально-экономических показателей;
	умеет	проводить расчеты экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов;
	владеет	методикой проведения анализа результатов расчетов экономических и социально-экономических показателей;
	Знает	Основы анализа внешней среды
	Умеет	Находить решения стандартных задач в профессиональной деятельности с учетом основ инновационного менеджмента
ПК-5 способность определения перспектив развития организации на основе оценки положения компании на рынке и тенденции влияния факторов внешней среды	Владеет	Способностью решать различные задачи профессиональной деятельности с учетом основных современных соци-экономических требований внешней среды;
		методами учета неопределенности и риска в проектах, а также методами оценки эффективности проекта

№ п/п	Контролируемые разделы / темы дисциплины	Коды и этапы формирования компетенций		Оценочные средства	
				текущий контроль	промежуточная аттестация
1	Раздел I. Понятие, сущность и содержание	ПК-2	Типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11);	Вопросы к экзамену 1-12.

риск-менеджмента			показателей деятельности хозяйствующих субъектов.	самостоятельная работа (Приложение 2)		
			Использовать на практике типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.	
			Типовыми методиками и действующей нормативно-правовой базой расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.	
		ПК - 10		Методы оценки вариантов управленческих решений в условиях неопределенности и риска.	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
				Разрабатывать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев социально – экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
				Методиками оценки социально-экономических последствий решений, принятых в условиях неопределенности и риска.	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.
Раздел II. Анализ рисков	ПК - 8	методы сбора и анализа исходных данных для расчета экономических и социально-экономических показателей;	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.		
		проводить расчеты экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов;	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.		
		методикой проведения анализа результатов расчетов экономических и социально-экономических показателей;	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.		
Раздел III. Основы теории принятия рискованных решений	ПК - 5	Основы анализа внешней среды	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.		
		Находить решения стандартных задач в профессиональной деятельности с учетом основ	решение практических заданий; ситуационные задачи	Вопросы к экзамену 1-12.		

		инновационного менеджмента	(ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	
		Способностью решать различные задачи профессиональной деятельности с учетом основных современных социально-экономических требований внешней среды; методами учета неопределенности и риска в проектах, а также методами оценки эффективности проекта	решение практических заданий; ситуационные задачи (ПР-11); самостоятельная работа (Приложение 2)	Вопросы к экзамену 1-12.

Оценочные средства для проверки сформированности компетенций

Код и формулировка компетенции	Задание
ПК-2 способность на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	<p>Компания собирается производить новый товар, для чего необходимо построить новый завод. Существует три варианта:</p> <p>1. Построить завод стоимостью 60 млн. руб. При этом возможен большой спрос с вероятностью 0,7 и низкий с вероятностью 0,3. Если спрос большой, то ожидается годовой доход в размере 25 млн. руб. в течение следующих пяти лет; если спрос низкий, то ежегодные убытки – 5 млн. руб.</p> <p>2. Построить маленький завод стоимостью 35 млн. руб. Здесь также возможен большой и маленький спрос с теми же вероятностями. При большом спросе ежегодный доход в течение пяти лет – 15 млн. руб., при низком – 2,5 млн. руб.</p> <p>3. Сразу завод не строить, а отложить решение на один год для сбора дополнительной информации, которая может быть позитивной и негативной с вероятностями 0,8 и 0,2 соответственно. Через год, если информация окажется позитивной можно построить большой или маленький завод по указанным выше ценам. Руководство компании может решить никакого завода не строить, если информация будет негативной. Вне зависимости от типа завода вероятности большого и низкого спроса меняются на 0,9 и 0,1 соответственно, если будет получена позитивная информация. Доходы за последующие четыре года остаются такими же, какими они были в 1 и 2 вариантах. Необходимо:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) построить дерево решений, учитывающее все возможности; 2) определить наиболее эффективную последовательность действий; 3) предположим, что строительная компания предложит фирме скидку, если она сразу приступит к строительству большого завода. Какова должна быть величина этой скидки (в процентах), чтобы компания отказалась от ранее выбранного варианта?
ПК 10 – способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений, разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности,	<p>Феномен «первого лица» К директору многопрофильного производственного объединения пришли два знакомых специалиста и предложили организовать на его предприятии цех пластмассовых изделий для выпуска полиэтиленовой пленки и некоторых поделок из пластика. Спрос на полиэтиленовую пленку значительно превышал предложение, что объяснялось интересом предпринимателей и населения к парниковому хозяйству. Высокие темпы роста этого спроса директором и его окружением прогнозировались на длительный период. Были и альтернативные предложения: организовать кирпичное производство, закупить акции «Менатеп», приобрести в Подмоскowie земли и начать строительство коттеджей, создать парниковое хозяйство или сравнительно дешево приобрести и освоить животноводческую ферму.</p> <p>Но дивиденды от акций «Менатеп» выглядели призрачно. Обилие рекламы по организации кирпичного производства давало основание считать, что кирпича через 2-3 года будет столько, что большую прибыль на нем получить будет трудно. Приобретение земли и строительство коттеджей упиралось в поиск надежного менеджера, получение кредита на приемлемых процентных ставках. Смущала также отдаленность земли от базовой фирмы. Создание парникового хозяйства и приобретение животноводческой фермы были отмечены как низкорентабельные и</p>

<p>рисков возможных социально- экономических послед-ствий</p>	<p>и</p> <p>трудоёмкие. Директору наиболее приемлемым показалось предложение создать пластмассовый цех, тем более что ходоки обещали дешево закупить, отремонтировать и отладить оборудование, дешево приобрести по известным им каналам гранулированный полиэтилен и полистирол. Основные заботы по организации и пуску производства они брали на себя. Для того чтобы убедиться в правоте своего выбора, директор провел совещание, на котором присутствовали заместитель по производству, главный экономист, руководители и технологи других производств. Выслушав доклад инициаторов нового производства, их аргументацию и мнение директора, собравшиеся быстро согласились на организацию такого производства в структуре своего объединения. Было также принято решение подключить специалистов со стороны к экспертизе исходных данных и подготовке технико-экономического обоснования, что впоследствии и было сделано.</p> <p>В намеченные сроки производство, однако, пустить не удалось. Купленное по низкой цене оборудование потребовало основательного восстановления, наладчики не покидали участок экструзии. В итоге ожидаемые затраты на пуско-наладку утроились, сроки пуска производства также значительно превзошли ожидаемые. К моменту пуска производства региональный рынок уже насытился относительно дешевой пленкой, за год все же удалось произвести около 40 000 метров пленки, но из-за ее высокой себестоимости пришлось повышать и цену, так как хотелось получить достаточную прибыль, чтобы разом окупить все затраты по созданию цеха. Покупатели же не торопились покупать этот товар, крупных оптовых закупок вообще не было. Реклама товара в основном велась через личные связи со знакомыми и соседними коммерсантами, без прессы. Склад затоварился, сбыта не было, производство потеряло коммерческий смысл. После нескольких инфляционных всплесков пленку все же продали. Но отношение к этому производству по сравнению с первоначальным изменилось на противоположное.</p> <p><u>Вопросы.</u></p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Ориентируется ли предприятие в своей деятельности на рынок? 2. Оцените процедуру накопления и отбора бизнес-идей на предприятии. 3. Какая служба и каким образом могла бы помочь директору предприятия в принятии решений?
<p>ПК-8 способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес- процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения</p>	<p>Ответить на следующие вопросы теста:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. К методам сбора первичной информации относят: <ol style="list-style-type: none"> 1)интервью 2)анкетирование 3)наблюдение 4)контент-анализ 2. К стандартизированным методикам оргдиагностики относят: <ol style="list-style-type: none"> 1)вопросник Р. Лайкерта «Профиль организационных характеристик» 2)вопросник Л. Константина «Шкалы организационных парадигм» 3)проективное интервью 4)диагностическое интервью 3. Метод наблюдения бывает: <ol style="list-style-type: none"> 1)включенным 2)невключенным 3)стандартизированным 4)нестандартизированным 4. Метод анализа документов бывает: <ol style="list-style-type: none"> 1)качественным 2)количественным 3)глубинным 4)групповым 5. Недостатком Метода «интервью» является: <ol style="list-style-type: none"> 1)Трудоёмкость 2)Пристрастность интервьюера

- 3)Трудности интерпретации
- 4)Пристрастность респондента

6. Достоинства метода «Интервью»:

- 1)Адаптивность (применимо для сбора различных данных)
- 2)Возможность установки обратной связи
- 3)Легкость квантификации и суммирования ответов
- 4)Простота использования на больших выборках

7. Достоинствами вопросников являются:

- 1)Легкость квантификации и суммирования ответов
- 2)Простота использования на больших выборках
- 3)Адаптивность
- 4)Возможность сбора большого объема данных

8. Недостатками применения вопросников являются:

- 1)Влияние вопросов на ответы
- 2)Пристрастность респондентов
- 3)Неэмпатичность
- 4)Сверхинтерпретация данных

9. Недостатками метода наблюдения являются:

- 1)Трудности кодирования и интерпретации
- 2)Несоответствие выборки целям диагностики
- 3)Трудоемкость
- 4) Простота использования на больших выборках

10. К достоинствам метода наблюдения относят:

- 1)Сбор данных о поведении, а не отчет о нем
- 2)Реальное время, а не ретроспектива
- 3)Адаптивность
- 4)Возможность сбора большого объема данных

11.Интенсивное и детальное интервью, предназначенное для выявления неизвестных переменных глубокого социально-психологического контекста- это _____ интервью

12. _____ - анализ – это стандартная методика исследования, предметом анализа которой является содержание текстовых массивов и продуктов коммуникативной корреспонденции

13.Методы с числовой оценкой уровня качеств работника относят к _____ методам оценки персонала

14. Количественные методы оценки персонала

- 1.Метод рангового порядка
- 2.Метод заданной балльной оценки
- 3.Метод свободной балльной оценки
- 4.Система графического профиля

А.Заключается в изображении каждого из деловых качеств сотрудника (в баллах) в виде точек на графике

Б. Состоит в присвоении руководителем или экспертом определенного количества баллов каждому качеству работника

В.Заключается в присвоении заранее установленных баллов за каждое достижение работника с последующим определением его общего делового уровня в виде набранных очков

Г. Группа руководителей, исходя из определенных критериев оценки, располагает оцениваемых сотрудников по порядку: от самого лучшего до самого худшего

15. Качественные методы оценки персонала

- 1. Матричный

	<p>2.Метод эталона 3.Система произвольных характеристик 4. Метод групповой дискуссии</p> <p>А.Сравнение фактических качеств работников с набором качеств, требуемых занимаемой должностью Б.Беседа группы руководителей или экспертов с работниками относительно их деятельности В. Руководитель или группа руководителей (экспертов) описывают выдающиеся успехи и упущения подчиненных за определенный период их деятельности. Г. Сравнивают фактические данные не с положенными по должности навыками и поведением, а с характеристиками наиболее успешных работников данного направления</p> <p>16.Разработка системы обучения персонала: 1.Выбор форм обучения 2.Анализ рынка услуг в области обучения 3.Анализ потребности в обучении 4.Бюджетирование затрат на обучение</p> <p>17.Постановка целей МВО происходит по следующей схеме: 1.Создать план действий для достижения этих целей 2.Установить ясные и четкие описания целей для сотрудников 3. Измерять достижение цели 4. Установить новые цели на будущее</p> <p>18. Анализ рациональности расстановки кадров позволяет определить: 1)соответствие образовательного и профессионально-квалификационного уровня персонала 2)сколько и каких должностей предусмотрено штатным расписанием 3)мероприятия по повышению квалификации работников, не соответствующих квалификационным требованиям</p> <p>19. Иерархичность, функциональное распределение обязанностей, система обязанностей и прав- это характеристики организационной структуры: 1)матричной 2)бюрократической 3)проектной 4)виртуальной</p> <p>20. Построение структурных подразделений и должностей по принципу прямого подчинения характеризует: 1)линейной модели организационной структуры 2)функциональной модели организационной структуры 3)дивизиональной модели организационной структуры 4)матричной модели организационной структуры</p>
<p>ПК-5 способность определения перспектив развития организации на основе оценки положения компании на рынке и тенденции влияния факторов внешней среды</p>	<p>Кейс.Холдинг «Машинстрой» (название условное) производит тракторы, бульдозеры, технику для коммунального хозяйства и оборонно-промышленного комплекса. Среди заказчиков – предприятия из России и небольших развивающихся стран. Конкуренция в том рыночном сегменте, где работает компания, не очень высока. Казалось бы, после девальвации рубля у нее появился шанс увеличить выпуск продукции. Но произошло все с точностью до наоборот. Подорожали импортные комплектующие, использующиеся при сборке машин. Компании не хватило оборотных средств для выполнения текущих заказов. Получить новые кредиты не удалось. Цепочка проблем привела к сокращению</p>

	<p>производства и персонала.</p> <ul style="list-style-type: none"> • <i>Какие вы видите решения по выводу из кризиса холдинга «Машинстрой»?</i> • <i>Как должны быть вписаны эти решения в общую стратегию развития холдинга?</i>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

Шкала оценивания уровня сформированности компетенций

Код и формулировка компетенции	Этапы формирования компетенции		Критерии	Показатели
ПК-2 способность на основе типовых методик и действующей нормативно – правовой базы рассчитать экономические и социально – экономические показатели, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.	знает (пороговый уровень)	Типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.	знание правовых, нормативных и (законодательные и нормативные акты РФ, и др.), необходимых для осуществления финансовой деятельностью	- способность перечислить и охарактеризовать правовые акты, регламентирующие финансовую деятельность; - способность грамотно интерпретировать показатели финансовой отчетности предприятия
	умеет (продвинутый)	Использовать на практике типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.	знает основные финансовые показатели для расчета бизнес-планов и критерии деловой и инвестиционной привлекательности	- способность проводить расчеты финансовых показателей, составлять финансовую, управленческую отчетность и финансовые отчеты с прогнозированием и построением ожиданий
	владеет (высокий)	Типовыми методиками и действующей нормативно-правовой базой расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.	владеет основными критериями эффективности проектами	- способность принимать эффективные управленческие решения на основе полученной финансовой информации
ПК – 10 способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений, разработать и обосновать предложения по	знает (пороговый уровень)	Методы оценки вариантов управленческих решений в условиях неопределенности и риска.	знание правовых, нормативных и (законодательные и нормативные акты РФ, и др.), необходимых для осуществления финансовой деятельностью	- способность перечислить и охарактеризовать правовые акты, регламентирующие финансовую деятельность; - способность грамотно интерпретировать показатели финансовой отчетности предприятия -

их совершенствованию с учетом критериев социально – экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	умеет (продвинутый)	Разрабатывать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев социально – экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	знает основные финансовые показатели для расчета бизнес-планов и критерии деловой и инвестиционной привлекательности	- способность проводить расчеты финансовых показателей, составлять финансовую, управленческую отчетность и финансовые отчеты с прогнозированием и построением ожиданий
	владеет (высокий)	Методиками оценки социально-экономических последствий решений, принятых в условиях неопределенности и риска.	владеет основными критериями эффективности проектами	- способность принимать эффективные управленческие решения на основе полученной финансовой информации
ПК-8 способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения	знает (пороговый уровень)	методы сбора и анализа исходных данных для расчета экономических и социально-экономических показателей;	знание правовых, нормативных и (законодательные и нормативные акты РФ, и др.), необходимых для составления бухгалтерской, управленческой и налоговой отчетности	- способность характеризовать полученную информацию на основании нормативных и законодательных актов
	умеет (продвинутый)	проводить расчеты экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов;	знает основные показатели в управленческой, налоговой и финансовой отчетности	- умеет грамотно интерпретировать показатели отчетности и проводить расчеты согласно бухгалтерским стандартам
	владеет (высокий)	методикой проведения анализа результатов расчетов экономических и социально-экономических показателей;	владеет основными навыками финансового моделирования и прогнозирования	- способность построения финансовых моделей предприятия, расчета затрат и разработки предложений для компаний
ПК-5 способность определения перспектив развития организации на основе оценки положения компании на рынке и тенденции	знает (пороговый уровень)	Основы анализа внешней среды	знание правовых, нормативных и (законодательные и нормативные акты РФ, и др.), необходимых для осуществления финансовой деятельностью	- способность перечислить и охарактеризовать правовые акты, регламентирующие финансовую деятельность; - способность грамотно интерпретировать показатели финансовой отчетности предприятия

влияния факторов внешней среды	умеет (продвинутый)	Находить решения стандартных задач в профессиональной деятельности с учетом основ инновационного менеджмента	знает основные финансовые показатели для расчета бизнес-планов и критерии деловой и инвестиционной привлекательности	- способность проводить расчеты финансовых показателей, составлять финансовую, управленческую отчетность и финансовые отчеты с прогнозированием и построением ожиданий
	владеет (высокий)	Способностью решать различные задачи профессиональной деятельности с учетом основных современных социо-экономических требований внешней среды; методами учета неопределенности и риска в проектах, а также методами оценки эффективности проекта	владеет основными критериями эффективности проектами	- способность принимать эффективные управленческие решения на основе полученной финансовой информации

Зачетно-экзаменационные материалы

Оценочные средства для промежуточной аттестации

Вопросы к экзамену

1. Понятие риска и функции риска.
2. Возможные причины возникновения рисков.
3. Классификация рисков.
4. Цель и задачи риск-менеджмента.
5. Качественный анализ рисков.
6. Общая характеристика методов количественного анализа рисков.
7. Вероятностная постановка принятия предпочтительных решений.
8. Методы теории игр.
9. Дерево решений.
10. Методы уменьшения рисков.
11. Стандарты построения системы управления рисками.

12. Разработка системы управления рисками.

Критерии оценки студента на экзамене по дисциплине

«Риск менеджмент»

Баллы (рейтингов ой оценки)	Оценка зачета/ экзамена (стандартная)	Требования к сформированным компетенциям
86-100	«зачтено»/ «отлично»	Оценка «отлично» выставляется студенту, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, причем не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, использует в ответе материал монографической литературы, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач.
76-85	«зачтено»/ «хорошо»	Оценка «хорошо» выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.
75-61	«зачтено»/ «удовлетворительно»	Оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при ответах на дополнительные вопросы.
менее 61	«не зачтено»/ «неудовлетворительно»	Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

Оценочные средства для текущей аттестации

Тематика практических занятий по дисциплине «Риск менеджмент»

Практическое занятие № 1-2. Дерево решений. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (4 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие № 3-4. Методы теории игр. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (2 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие № 5-6. Вероятностные методы принятия предпочтительных решений. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (2 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие № 7-8. Методы уменьшения рисков. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (2 час.)

Решение ситуационных задач.

Практическое занятие № 9-10. Стандарты систем управления рисками. (4 час.)

Метод активного / интерактивного обучения – метод ситуационного анализа (ситуационные задачи/кейс-стади) (2 час.)

Решение ситуационных задач.

Критерии оценки:

- 100-86 баллов выставляется студенту, если студент выразил свое мнение по сформулированной проблеме, аргументировал его, точно определив ее содержание и составляющие. Приведены данные нормативных и технических документов. Студент знает и владеет навыком самостоятельной исследовательской работы по теме исследования; методами

и приемами анализа теоретических и/или практических аспектов изучаемой области. Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет; графически работа оформлена правильно;

- 85-76 баллов – работа характеризуется смысловой цельностью, связностью и последовательностью изложения; допущено не более 1 ошибки при объяснении смысла или содержания проблемы. Для аргументации приводятся данные нормативных и технических документов. Продемонстрированы исследовательские умения и навыки. Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет. Допущены одна-две ошибки в оформлении работы;

- 75-61 балл – студент проводит достаточно самостоятельный анализ основных этапов и смысловых составляющих проблемы; понимает базовые основы и теоретическое обоснование выбранной темы. Привлечены нормативные и технические документы. Допущено не более 2 ошибок в смысле или содержании проблемы, оформлении работы;

- 60-50 баллов – если работа представляет собой полностью переписанный исходный текст, без каких бы то ни было комментариев, анализа. Не раскрыта структура и теоретическая составляющая темы. Допущено три или более трех ошибок в смысловом содержании раскрываемой проблемы, в оформлении работы.

Задачи для проведения практических занятий

Тема: дерево решений

Задача 1. Предприятие разработало новый товар. Стоимость производства товара – 2,5 млн. руб. Для организации производства потребуется год, однако вероятность того, что будет обеспечена необходимая безопасность технологического процесса, составляет 0,55. В связи с этим встает вопрос о разработке компьютерной контролирующей системы (ККС), которая обеспечит безопасность. Исследования по её созданию продлятся год

и будут стоить 1 млн. руб. При этом вероятность успешного создания ККС – 0,75. Разработку ККС можно начать либо немедленно, либо подождать год до выяснения безопасности технологического процесса. В случае, если продажа нового товара начнется через год, то доход составит 10 млн. руб. Если отложить выпуск товара на год, то доход упадет до 8,5 руб. из-за возможного появления конкурентов. Необходимо:

- 1) построить дерево решений;
- 2) принять решение;
- 3) выяснить, как должна измениться вероятность успешной разработки ККС, чтобы изменилось решение.

Задача 2. Химическая фирма выпускает промышленный растворитель, срок хранения которого не превышает 1 мес. Объем выпуска продукции планируется вначале каждого месяца. Известно ежемесячный спрос может находиться в пределах от 10 до 20 т. Стоимость производства тонны растворителя – 40000 р., цена, по которой продается тонна растворителя – 60000 р. Для удобства рассматривают: низкий спрос 10 т /мес., вероятность которого составляет 0,3; средний – 15 т /мес. с вероятностью 0,6 и высокий 20 т /мес. с вероятностью 0,1. Необходимо:

- 1) построить дерево решений;
- 2) принять решение.

Задача 3. В консалтинговую фирму обратился клиент с просьбой рассмотреть варианты инвестирования 1 млн. руб. сроком на два года. В результате маркетингового исследования были предложены два варианта – А и Б, один из которых содержит небольшой риск, второй без риска. Вариант А предусматривает несколько возможных размеров прибыли: 8%, 10%, 12%. Из-за особенностей инвестируемого объекта существует связь доходов первого и второго годов.

Первый год	Второй год		
	8%	10%	12%
8%	0,6	0,3	0,1
10%	0,2	0,5	0,3

12%	0,1	0,2	0,7
-----	-----	-----	-----

На первом этапе все три варианта прибыли равновероятны. Вариант Б предусматривает стабильную прибыль 9,5% годовых. Необходимо:

- 1) построить дерево решений;
- 2) выбрать вариант инвестирования;
- 3) выяснить, как изменится дерево решений, если станет возможным перейти от одного варианта к другому в конце первого года.

Задача 4. Компания собирается производить новый товар, для чего необходимо построить новый завод. Существует три варианта:

1. Построить завод стоимостью 60 млн. руб. При этом возможен большой спрос с вероятностью 0,7 и низкий с вероятностью 0,3. Если спрос большой, то ожидается годовой доход в размере 25 млн. руб. в течение следующих пяти лет; если спрос низкий, то ежегодные убытки – 5 млн. руб.

2. Построить маленький завод стоимостью 35 млн. руб. Здесь также возможен большой и маленький спрос с теми же вероятностями. При большом спросе ежегодный доход в течение пяти лет – 15 млн. руб., при низком – 2,5 млн. руб.

3. Сразу завод не строить, а отложить решение на один год для сбора дополнительной информации, которая может быть позитивной и негативной с вероятностями 0,8 и 0,2 соответственно. Через год, если информация окажется позитивной можно построить большой или маленький завод по указанным выше ценам. Руководство компании может решить никакого завода не строить, если информация будет негативной. Вне зависимости от типа завода вероятности большого и низкого спроса меняются на 0,9 и 0,1 соответственно, если будет получена позитивная информация. Доходы за последующие четыре года остаются такими же, какими они были в 1 и 2 вариантах. Необходимо:

- 1) построить дерево решений, учитывающее все возможности;
- 2) определить наиболее эффективную последовательность действий;

3) предположим, что строительная компания предложит фирме скидку, если она сразу приступит к строительству большого завода. Какова должна быть величина этой скидки (в процентах), чтобы компания отказалась от ранее выбранного варианта?

Задача 5. Пекарня печет хлеб на продажу магазинам. Себестоимость одной булки составляет 15 рублей, её продают за 20 рублей. Ниже приведены данные о спросе за последние 50 дней:

<i>Спрос в день, тыс. шт.</i>	10	12	14	16	18
<i>Число дней</i>	5	10	15	15	5

Если булка испечена, но не продана, то убытки составляют 10 рублей за штуку. Используя каждое из правил определить, сколько булок надо выпекать в день.

Задача 6. Администрации театра надо решить, сколько заказать программ для представления. Стоимость заказа 15 т.р. плюс 30р за штуку. Программки продаются за 50р. за штуку, к тому же доходы от рекламы дополнительно составляют 22 т.р. Из прошлого опыта известна посещаемость театра:

<i>Посещаемость</i>	4000	4500	5000	5500	6000
<i>Её вероятность</i>	0,1	0,3	0,3	0,2	0,1

Ожидается, что 40% зрителей купят программки. Необходимо:

1. Используя каждое из правил определить, сколько программ должна заказать администрация театра.
2. Допустим, что рекламодатели увеличат сумму до 30 т.р., число посетителей будет больше 5250, к тому же на программки полностью удовлетворен. Как это повлияет на рекомендации?

Задача 7. Компания выпускает напиток, который упаковывается в 12-литровые бочки. Напиток готовится в течение недели и каждый понедельник очередная партия готова к употреблению. Переменные затраты на производство 1л. напитка составляют 60р.

<i>Спрос на бочки в неделю</i>	3	4	5	6	7
--------------------------------	---	---	---	---	---

Задача 11. Пусть имеются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,6 обеспечивает прибыль 15 млн. руб., однако с вероятностью 0,4 можно потерять 5,5 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,8 можно получить прибыль 10 млн. руб. и с вероятностью 0,2 потерять 6 млн. руб. Необходимо выбрать один из проектов.

Задача 12. Акционерному обществу предлагают два рискованных проекта. Исходные данные приведены ниже:

Показатель	Проект 1			Проект 2		
	0,2	0,6	0,2	0,4	0,2	0,4
Вероятность события						
Наличные поступления, млн. руб.	40	50	60	0	50	100

Учитывая тот факт, что фирма имеет долг в 80 млн. руб., необходимо выбрать проект.

Задача 13. Найти результирующую оценку на основе экспертизы численного оценивания. Оценить степень согласованности мнений экспертов и значимость полученных результатов. Исходные данные выбираются в зависимости от варианта, см. табл.А. Оценки экспертов приведены в табл.Б и табл.В (конкретная таблица выбирается в зависимости от варианта).

Таблица А. Варианты расчетного задания

Номер вариант а	Номера экспертов	Используемая таблица	$P_{\text{ош}}$
0	1-10	2	0,1
1	2-11	2	0,05
2	3-12	2	0,1
3	4-13	3	0,05
4	5-14	3	0,1
5	6-15	3	0,05
6	1-5, 7-11	2	0,1
7	2-6, 8-12	2	0,05
8	3-7, 9-13	3	0,1
9	4-8, 10-14	3	0,05

Таблица Б. Оценки экспертов

Номер эксперта	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
Оценка	11	9	10	12	11	13	12	11	10	7	9	9	10	12	13

Таблица В. Оценки экспертов

Номер эксперта	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
Оценка	12	13	9	10	9	9	7	11	9	10	12	11	13	12	11

Критерии оценки:

- 100-86 баллов выставляется студенту, если студент выразил свое мнение по сформулированной проблеме, аргументировал его, точно определив ее содержание и составляющие. Приведены данные нормативных и технических документов. Студент знает и владеет навыком самостоятельной работы по теме исследования; методами и приемами анализа теоретических и/или практических аспектов изучаемой области. Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет; графически работа оформлена правильно;

- 85-76 баллов – работа характеризуется смысловой цельностью, связностью и последовательностью изложения; допущено не более 1 ошибки при объяснении смысла или содержания проблемы. Для аргументации приводятся данные нормативных и технических документов. Продемонстрированы практические умения и навыки. Фактических ошибок, связанных с пониманием проблемы, нет. Допущены одна-две ошибки в оформлении работы;

- 75-61 балл – студент проводит достаточно самостоятельный анализ основных этапов и смысловых составляющих проблемы; понимает базовые основы и теоретическое обоснование выбранной темы. Привлечены нормативные и технические документы. Допущено не более 2 ошибок в смысле или содержании проблемы, оформлении работы;

- 60-50 баллов – если работа представляет собой полностью

переписанный исходный текст, без каких бы то ни было комментариев, анализа. Не раскрыта структура и теоретическая составляющая темы. Допущено три или более трех ошибок в смысловом содержании раскрываемой проблемы, в оформлении работы.

**Тематика групповых докладов
по дисциплине «Риск менеджмент»**

1. Основные аксиомы риск-менеджмента.
2. Законы управления рисками.
3. Принципы риск-менеджмента.
4. Понятие и сущность процессного подхода. Технология управления.
5. Внешний и внутренний мониторинг рисков.
6. Планирование в системе риск-менеджмента.
7. Мотивирование как функция риск-менеджмента.
8. Учет и контроль в системе управления рисками.
9. Оценка эффективности управления рисками.
10. Понятие и виды методов управления рисками.
11. Юридические методы управления рисками.
12. Административные методы риск-менеджмента.
13. Экономические методы управления рисками.
14. Понятие и содержание социальных методов управления.
15. Психологические методы управления рисками.
16. Производственные методы риск-менеджмента.
17. Роль научно-прикладных методов управления в риск-менеджменте.

Критерии оценки выполнения коллективного научно-исследовательского, творческого задания

№ п/п	Критерий	Количество баллов
----------	----------	----------------------

1	Готовность результатов самостоятельной работы в срок	10
2	Доклад с демонстрацией презентации, ответы на вопросы аудитории	20
3	Материал современный, актуальный, интересный для аудитории	25
4	Тема раскрыта глубоко, изложение материала логично, аргументированно, подкреплено иллюстрациями, таблицами и диаграммами с фактическими данными, схемами и рисунками	25
5	Наличие папки с нормативно-законодательными актами, закладками в СПС Консультант Плюс, презентации и файла MS Word с текстовым материалом	20
	ИТОГО	100

Методические рекомендации, определяющие процедуры оценивания результатов освоения дисциплины

Текущая аттестация студентов. Текущая аттестация студентов по дисциплине «Риск менеджмент» проводится в соответствии с локальными нормативными актами ДВФУ и является обязательной.

Текущая аттестация по дисциплине «Риск менеджмент» проводится в форме контрольных мероприятий (выполнение заданий на практических занятиях, решение ситуационных задач, написание групповых докладов) по оцениванию фактических результатов обучения студентов и осуществляется ведущим преподавателем.

Объектами оценивания выступают:

- учебная дисциплина (активность на занятиях, своевременность выполнения различных видов заданий, посещаемость всех видов занятий по аттестуемой дисциплине);

- степень усвоения теоретических знаний ((активность в ходе обсуждений материалов практических занятий, активное участие в дискуссиях с аргументами из дополнительных источников, внимательность, способность задавать встречные вопросы в рамках дискуссии или обсуждения, заинтересованность изучаемыми материалами);

- уровень овладения практическими умениями и навыками по всем видам учебной работы (определяется по результатам решения заданий);

- результаты самостоятельной работы (задания и критерии оценки размещены в Приложении 1).

Промежуточная аттестация студентов. Промежуточная аттестация студентов по дисциплине «Риск менеджмент» проводится в соответствии с локальными нормативными актами ДВФУ и является обязательной.

Итоговый контроль. Предусматривает рейтинговую оценку по учебной дисциплине в течении семестра в процессе обучения.

Краткая характеристика процедуры применения используемого оценочного средства. В результате посещения практических занятий, семинаров и круглых столов студент последовательно осваивает материалы дисциплины и изучает ответы на вопросы к экзамену, представленные в структурном элементе ФОС IV.1. В ходе промежуточной аттестации студент готовит индивидуальное творческое экзаменационное задание (индивидуальное творческое задание к экзамену размещено в структурном элементе ФОС IV.2). Критерии оценки студента на экзамене представлены в структурном элементе ФОС IV.3. Критерии оценки текущей аттестации – контрольная проверка знаний (практические занятия, групповое творческое задание) представлены в структурном элементе ФОС V.

**Критерии выставления оценки студенту на экзамене
по дисциплине «Риск менеджмент»**

Баллы (рейтингово й оценки)	Оценка по зачету (стандартная)	Требования к сформированным компетенциям
86-100	«отлично»	Оценка «отлично» выставляется студенту, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, причем не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, использует в ответе материал монографической литературы, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач.
85-76	«хорошо»	Оценка «хорошо» выставляется студенту, если он

		<p>твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.</p>
75-61	«удовлетворительно»	<p>Оценка «удовлетворительно» выставляется студенту, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при выполнении практических работ.</p>
60-0	«неудовлетворительно»	<p>Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.</p>