

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РЕСПУБЛИКИ ТАТАРСТАН

Государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Альметьевский государственный нефтяной институт»



УТВЕРЖДАЮ

Первый проректор АГНИ

А.Ф. Иванов

06 2018г.

Рабочая программа дисциплины Б1.В.10

РИСК - МЕНЕДЖМЕНТ

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль) программы: Производственный менеджмент

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очная

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2018г

Статус	ФИО	Подпись	Дата
Автор	О.А. Фатхутдинова		13.06.2018
Рецензент	О.В. Антипова		19.06.2018
Зав. выпускающей (обеспечивающей) кафедрой экономики и управления предприятием	Р.Ш. Садыкова		20.06.2018

Альметьевск, 2018г.

Содержание

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы
2. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы высшего образования
3. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем и на самостоятельную работу обучающихся
4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий
 - 4.1. Структура и тематический план контактной и самостоятельной работы по дисциплине
 - 4.2. Содержание дисциплины
5. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине
6. Фонд оценочных средств по дисциплине
 - 6.1. Перечень оценочных средств
 - 6.2. Уровень освоения компетенций и критерии оценивания результатов обучения
 - 6.3. Варианты оценочных средств
 - 6.4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций
7. Перечень основной, дополнительной учебной литературы и учебно-методических изданий, необходимых для освоения дисциплины
8. Перечень профессиональных баз данных, информационных справочных систем и информационных ресурсов, необходимых для освоения дисциплины
9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины
10. Перечень программного обеспечения
11. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине
12. Средства адаптации преподавания дисциплины к потребностям обучающихся лиц с ограниченными возможностями здоровья

ПРИЛОЖЕНИЯ

- Приложение 1. Аннотация рабочей программы дисциплины
Приложение 2. Лист внесения изменений
Приложение 3. Фонд оценочных средств

Рабочая программа дисциплины «Риск - менеджмент» разработана доцентом кафедры экономики и управления предприятием Фатхутдиновой О.А.

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Компетенции обучающегося формируемые в результате освоения дисциплины «Риск - менеджмент»:

Оцениваемые компетенции (код, наименование)	Результаты освоения компетенции	Оценочные средства текущего контроля и промежуточной аттестации
ПК-9 Способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли	знать: – методы анализа, оценки и управления рисками; уметь: – выявлять и анализировать рыночные и специфические риски владеть: – навыками проведения анализа рыночных и специфических рисков	Текущий контроль: Компьютерное тестирование по темам 1-7 Практические задания по темам 1-6 Промежуточная аттестация: Экзамен
ПК-15 Умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	знать: – основную терминологию в области риск-менеджмента, о значении инвестиций на предприятиях реального сектора экономики, финансовых последствиях различных видов риска, о системе риск-менеджмента предприятия уметь: – проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, разрабатывать мероприятия по управлению рисками проекта владеть: – навыками выполнения анализа рисков и принятия управленческих решений в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании рискованных событий.	Текущий контроль: Компьютерное тестирование по темам 1-7 Практические задания по темам 1-6 Промежуточная аттестация: Экзамен

2. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы высшего образования

Дисциплина «Риск - менеджмент» является обязательной дисциплиной, входит в состав Блока 1 «Дисциплины (модули)» и относится к вариативной части ОПОП по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль) программы – Производственный менеджмент.

Дисциплина изучается на 3 курсе в 5 семестре.

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

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных единиц, 108 часов.

Контактная работа обучающихся с преподавателем 32 - часа, в том числе:

- лекции 15 ч.;
- практические занятия 15 ч.;
- КСР 2 ч.

Самостоятельная работа 40 ч.

Контроль (экзамен) – 36 часов.

Форма промежуточной аттестации дисциплины: экзамен в 5 семестре.

4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

4.1. Структура и тематический план контактной и самостоятельной работы по дисциплине

Тематический план дисциплины

№ п/п	Темы дисциплины	семестр	Виды и часы контактной работы, их трудоемкость (в часах)				Самостоятельная работа
			лекции	практические занятия	лабораторные занятия	КСР	
1.	Понятие и классификация рисков	5	4	2	-	1	5
2.	Современные подходы к построению интегрированной системы управления рисками компании	5	2	4			5
3.	Методы оценки риска	5	2	2	-		6
4.	Кредитные риски: понятие, виды и способы управления	5	2	2	-	1	6
5.	Понятие и виды рыночных рисков	5	2	2	-		6
6.	Сущность и инструменты хеджирования	5	2	3	-		6
7.	Операционный риск	5	1	-	-		6
	Итого по дисциплине		15	15	-	2	40

4.2 Содержание дисциплины

Тема	Кол-во часов	Используемый метод	Формируемые компетенции
Дисциплинарный модуль 5.1			
Тема 1. Понятие и классификация рисков (6ч.)			
<i>Лекция 1.</i> Сущность и понятие риска. Виды рисков, принципы их классификации. Понятие управления рисками. Риск-менеджмент. Потребности предприятий в управлении рисками. Общая схема управления рисками. Примеры схем управления рисками.	2	<i>Лекция-визуализация</i>	ПК-9, ПК-15
<i>Лекция 2.</i> Система управления рисками. характеристика основных методов управления и финансирования рисков. Оценка эффективности текущего управления рисками	2		ПК-9, ПК-15
<i>Практическое занятие 1.</i> Определение дополнительного объема финансирования.	2	<i>Разбор конкретной ситуации</i>	ПК-9, ПК-15
Тема 2. Современные подходы к построению интегрированной системы управления рисками компании (6ч.)			
<i>Лекция 3.</i> Цели в области управления рисками. Компоненты и элементы системы управления рисками (СУР). Алгоритм действий при выявлении рисков. Определение понятий «рисковое последствие», «рисковое событие». Взаимосвязь рисковых последствий и цели. Методики определения возможных событий. Соотнесение рисковых событий с целью. Взаимосвязь целей и событий. Определение понятия «рисковый фактор». Взаимосвязь рисковых событий и факторов. Внешние и внутренние факторы. Взаимосвязь рисковых факторов, событий и последствий. Алгоритм построения сценариев развития рисков. Алгоритм построения реестра рисков	2	<i>Лекция-визуализация</i>	ПК-9, ПК-15
<i>Практическое занятие 2.</i> Выявление последствий реализации рисковых событий. Выявление рисковых событий, влияющих на достижение целей. Выявление факторов рисковых событий. Классификация перечня рисковых событий	2	<i>Деловая игра</i>	ПК-9, ПК-15
<i>Практическое занятие 3.</i> Построение реестра рисков. Качественная оценка рисков. Построение карты рисков. Методы управления рисками. Оценка эффективности мероприятий по управлению рисками. Составление плана реализации мероприятий по управлению рисками.	2	<i>Деловая игра</i>	ПК-9, ПК-15
Тема 3. Методы оценки риска (4ч.)			
<i>Лекция 4.</i> Анализ риска. Экономико-статистические методы. Экспертные методы оценки риска. Смешанные методы оценки риска. Анализ зон риска (СРС)	2		ПК-9, ПК-15
<i>Практическое занятие 4.</i> Количественная и качественная оценка риска	2		ПК-9, ПК-15
Дисциплинарный модуль 5.2			
Тема 4. Кредитные риски: Понятие, виды и способы управления (4ч.)			
<i>Лекция 5.</i> Понятие кредитного риска в широком и узком смысле слова. Формы обеспечения возвратности кредита. Основные способы управления кредитным риском.	2	<i>Лекция-визуализация</i>	ПК-9, ПК-15
<i>Практическое занятие 5.</i> «Кредитные риски: Понятие, виды и способы управления»	2	<i>Разбор конкретной ситуации</i>	ПК-9, ПК-15

Тема 5. Понятие и виды рыночных рисков (4ч.)			
<i>Лекция 6.</i> Понятие рыночный риск и основные способы управления рыночными рисками. Валютный риск организации. Процентный риск банка. Рыночные риски российских участников ВЭД. Рынок нефти – нестандартные возможности управления ценовыми рисками	2		ПК-9, ПК-15
<i>Практическое занятие 6.</i> Валютный риск организации. Расчет риска открытой валютной позиции и его регулирование	2		ПК-9, ПК-15
Тема 6. Сущность и инструменты хеджирования (5ч.)			
<i>Лекция 7.</i> Хеджирование как способ страхования рыночных рисков. Эффективное хеджирование. Валютные и процентные СВОПы как инструмент страхования рисков.	2		ПК-9, ПК-15
<i>Практическое занятие 7.</i> Особенности хеджирования с использованием форвардных, фьючерсных и опционных контрактов Расчет показателей.	3		ПК-9, ПК-15
Тема 7. Операционный риск (1ч.)			
<i>Лекция 8.</i> Операционный риск. Юридические, бухгалтерские и налоговые риски.	1	<i>Групповое обсуждение</i>	ПК-9, ПК-15

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

Самостоятельная работа обучающихся выполняется по заданию преподавателя, без его непосредственного участия.

Самостоятельная работа студентов направлена на самостоятельное изучение отдельных аспектов тем дисциплины.

Цель самостоятельной работы – подготовка современного компетентного специалиста и формирования способностей и навыков к непрерывному самообразованию и профессиональному совершенствованию.

Самостоятельная работа способствует формированию аналитического и творческого мышления, совершенствует способы организации исследовательской деятельности, воспитывает целеустремленность, систематичность и последовательность в работе студентов, обеспечивает подготовку студента к текущим контактным занятиям и контрольным мероприятиям по дисциплине. Результаты этой подготовки проявляются в активности студента на занятиях и в качестве выполненных тестовых заданий, и других форм текущего контроля.

Самостоятельная работа может включать следующие виды работ:

- изучение понятийного аппарата дисциплины;
- проработка тем дисциплины, поиск информации в электронных библиотечных системах;
- подготовка практическим занятиям;
- работа с основной и дополнительной литературой, представленной в рабочей программе;
- подготовка к промежуточной аттестации;
- изучение материала, вынесенного на самостоятельную проработку;
- изучение сайтов по темам дисциплины в сети Интернет с целью подготовки докладов и презентаций;

Темы для самостоятельной работы обучающегося, порядок их контроля по дисциплине «Риск - менеджмент» приведены в методических указаниях:

Фатхутдинова О.А. Риск - менеджмент: методические указания по проведению практических занятий и организации самостоятельной работы по дисциплине «Риск - менеджмент» для бакалавров направления подготовки 38.03.02 – Менеджмент, направленность (профиль) программы – «Производственный менеджмент» очной формы обучения. – Альметьевск: АГНИ, 2017. – 40 с.

6. Фонд оценочных средств по дисциплине

Основной целью формирования ФОС по дисциплине «Риск - менеджмент» является создание материалов для оценки качества подготовки обучающихся и установления уровня освоения компетенций.

Полный перечень оценочных средств текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине приведен в Фонде оценочных средств (приложение 3 к данной рабочей программе).

Текущий контроль освоения компетенций по дисциплине проводится при изучении теоретического материала, решении и защите задач на практических.

Итоговой оценкой освоения компетенций является промежуточная аттестация в форме экзамена, проводимая с учетом результатов текущего контроля.

6.1. Перечень оценочных средств

Этапы формирования компетенций	Вид оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
Текущий контроль			
1	Практическое задание	Средство оценки умения применять полученные теоретические знания в практической ситуации. Задача должна быть направлена на оценивание тех компетенций, которые подлежат освоению в данной дисциплине, должна содержать четкую инструкцию по выполнению или алгоритм действий.	Комплект задач и заданий
2	Тестирование компьютерное	Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося по соответствующим компетенциям. Обработка результатов тестирования на компьютере обеспечивается специальными программами. Позволяет проводить самоконтроль (репетиционное тестирование), может выступать в роли тренажера при подготовке к зачету или экзамену	Фонд тестовых заданий, вопросы для подготовки к тестированию
Промежуточная аттестация			

3	Экзамен	Итоговая форма определения степени достижения запланированных результатов обучения (оценивания уровня освоения компетенций). Экзамен нацелен на комплексную проверку освоения дисциплины. Экзамен проводится в устной форме или в форме тестирования по всем темам дисциплины. Обучающемуся дается время на подготовку. Оценивается владение материалом, его системное освоение, способность применять нужные знания.	Перечень вопросов и задач к экзамену
---	---------	---	--------------------------------------

6.2. Уровень освоения компетенций и критерии оценивания результатов обучения

№ п/п	Оцениваемые компетенции (код, наименование)	Планируемые результаты обучения	Уровень освоения компетенций			
			Продвинутый уровень	Средний уровень	Базовый уровень	Компетенции не освоены
			Критерии оценивания результатов обучения			
			«отлично» (от 86 до 100 баллов)	«хорошо» (от 71 до 85 баллов)	«удовлетворительно» (от 55 до 70 баллов)	«неудовлетв.» (менее 55 баллов)
1	ПК-9 Способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли	знать: методы анализа, оценки и управления рисками	детально и подробно объясняет методы анализа, оценки и управления рисками	объясняет методы анализа, оценки и управления рисками	объясняет не полностью методы анализа, оценки и управления рисками	не объясняет методы анализа, оценки и управления рисками, нет правильных ответов, отсутствуют знания.
		уметь: выявлять и анализировать рыночные и специфические риски	полностью выявляет и анализирует рыночные и специфические риски	выявляет и анализирует рыночные и специфические риски, но при этом допускает неточности	частично выявляет и анализирует рыночные и специфические риски, но при этом допускает существенные ошибки	не выявляет и не анализирует рыночные и специфические риски, отсутствуют либо не полно раскрыты умения.
		владеть: навыками проведения анализа рыночных и специфических рисков	успешно владеет навыками проведения анализа рыночных и специфических рисков	владеет навыками проведения анализа рыночных и специфических рисков, но допускает несущественные ошибки	владеет навыками проведения анализа рыночных и специфических рисков, но допускает существенные ошибки	полное отсутствие навыков проведения анализа рыночных и специфических рисков, нет правильных ответов.
2	ПК-15 Умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	знать: основную терминологию в области риск-менеджмента, о значении инвестиций на предприятиях реального сектора экономики, финансовых последствиях различных видов риска, о системе риск-менеджмента предприятия	детально и подробно объясняет основную терминологию в области риск-менеджмента, о значении инвестиций на предприятиях реального сектора экономики, финансовых последствиях различных видов риска, о системе риск-менеджмента предприятия	объясняет основную терминологию в области риск-менеджмента, о значении инвестиций на предприятиях реального сектора экономики, финансовых последствиях различных видов риска, о системе риск-менеджмента предприятия	объясняет не полностью основную терминологию в области риск-менеджмента, о значении инвестиций на предприятиях реального сектора экономики, финансовых последствиях различных видов риска, о системе риск-менеджмента предприятия	не объясняет основную терминологию в области риск-менеджмента, о значении инвестиций на предприятиях реального сектора экономики, финансовых последствиях различных видов риска, о системе риск-менеджмента

						предприятия, нет правильных ответов, отсутствуют знания.
		уметь: проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, разрабатывать мероприятия по управлению рисками проекта	полностью проводит анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, разрабатывает мероприятия по управлению рисками проекта	проводит анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, разрабатывает мероприятия по управлению рисками проекта, но при этом допускает неточности	частично проводит анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, разрабатывает мероприятия по управлению рисками проекта, но при этом допускает существенные ошибки	не проводит анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, не разрабатывает мероприятия по управлению рисками проекта, отсутствуют либо не полно раскрыты умения.
		владеть: навыками выполнения анализа рисков и принятия управленческих решений в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании рисков событий.	успешно владеет навыками выполнения анализа рисков и принятия управленческих решений в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании рисков событий.	владеет навыками выполнения анализа рисков и принятия управленческих решений в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании рисков событий, но допускает несущественные ошибки	владеет навыками выполнения анализа рисков и принятия управленческих решений в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании рисков событий, но допускает существенные ошибки	полное отсутствие навыков выполнения анализа рисков и принятия управленческих решений в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании рисков событий, нет правильных ответов.

6.3. Варианты оценочных средств

6.3.1. Тестирование компьютерное

6.3.1.1. Порядок проведения

Тестирование компьютерное по дисциплине «Риск - менеджмент» проводится два раза в течение семестра. Банк тестовых заданий содержит список вопросов и различные варианты ответов.

6.3.1.2. Критерии оценивания

Результат теста зависит от количества вопросов, на которые был дан правильный ответ.

6.3.1.3. Содержание оценочного средства

Тестовые задания для оценки уровня сформированности компетенций

№ п/п	Компетенция	Вопрос	Варианты ответов			
			1	2	3	4
Дисциплинарный модуль 5.1.						
1	ПК-9	Вероятность понести убытки вследствие невыполнения обязательств контрагентом по любой сделке – это:	валютный риск	кредитный риск	базисный риск	операционный риск
2	ПК-9	Спекулятивный риск - это:	вероятность возникновения неблагоприятных финансовых последствий в форме потери дохода или капитала	риск, связанный с движением рыночных цен	вид рисков, связанных с движением рыночных цен, которое может привести как к прибыли, так и к убыткам	вероятность понести убытки вследствие невыполнения обязательств контрагентом по любой сделке
3	ПК-15	Вероятность понести убытки или чрезмерные расходы вследствие непредвиденного и неблагоприятного изменения курса валюты – это:	операционный риск	базисный риск	деловой риск	валютный риск
4	ПК-15	Систематический риск - это:	риск, связанный с изменением конъюнктуры всего финансового рынка или его сегментов под воздействием макроэкономических факторов.	вероятность возникновения неблагоприятных финансовых последствий в форме потери дохода или капитала	измеритель частоты возможного наступления неблагоприятной ситуации с неизбежными финансовыми потерями	вероятность понести убытки вследствие невыполнения обязательств контрагентом по любой сделке
Дисциплинарный модуль 5.2.						

5	ПК-9	Риск того, что соотношение цен спот и производного финансового инструмента будет меняться с течением времени – это:	валютный риск	банковский риск	простой риск	базисный риск
6	ПК-9	Финансовый риск возникает:	в процессе производственной деятельности	в процессе отношений предприятий с банками	в процессе закупки сырья и материалов	нет правильного ответа
7	ПК-15	Портфель, оптимальный с точки зрения отдельного инвестора, определяется в первую очередь:	уровнем дохода инвестора	его отношением к риску	его местом на рынке	кредитоспособностью
8	ПК-15	Соглашение между двумя сторонами о будущей поставке предмета контракта, которое заключается вне биржи, это:	опцион	хеджирование	форвардный контракт	свопцион

6.3.2. Практическое задание

6.3.2.1. Порядок проведения

Практические задания выполняются обучающимися самостоятельно с использованием лекционного материала, а также материалов из списка рекомендованной основной и дополнительной литературы и нормативно-правовых источников во время аудиторных занятий.

По результатам выполненных заданий проводится защита решенных задач. Студент должен продемонстрировать знание методики выполнения работы, уметь интерпретировать полученные результаты. Студент должен дать полный, развернутый и обоснованный ответ на соответствующее задание в письменной форме. Ответ студента должен содержать собственное мнение по существу заданного задания (задачи). Ответ студента оценивается преподавателем в соответствии с установленными критериями

6.3.2.2. Критерии оценивания

Баллы в интервале 86-100% от максимальных ставятся (максимальный балл по каждому практическому заданию приведен в п. 6.4), если обучающимся:

- умеет разбирать альтернативные варианты решения практических задач, развиты навыки критического анализа проблем, предлагает новые решения в рамках поставленной задачи.

Баллы в интервале 71-85% от максимальных ставятся, если обучающийся:

- показал умение самостоятельно решать конкретные практические задачи, но допустил некритичные неточности и доказательства в ответе и решении.

Баллы в интервале 55-70% от максимальных ставятся, если обучающийся:

- в состоянии решать задачи в соответствии с заданным алгоритмом, однако допускает ряд ошибок при решении конкретной практической задачи из числа предусмотренных рабочей программой дисциплины.

Баллы в интервале 0-54% от максимальных ставятся, если обучающийся:

- допускает грубые ошибки в решении типовых практических задач (неумение с помощью преподавателя получить правильное решение конкретной практической задачи из числа предусмотренных рабочей программой дисциплины).

6.3.2.3. Содержание оценочного средства

Пример задач для оценки сформированности компетенции ПК-9

Задача 1

Провести оценку риска двух инвестиционных проектов. Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 150 тыс. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 16,7 тыс. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,6 можно получить прибыль 180 тыс. руб. и с вероятностью 0,4 потерять 20,0 тыс. руб. Какой проект выбрать?

Задача 2

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта (табл. 3).

Учитывая, что фирма имеет долг в 90 млн. руб., какой проект должны выбрать акционеры и почему?

Таблица 3 - Исходные данные проектов

Заданные параметры	Проекты					
	Проект 1			Проект 2		
Вероятность события	0,2	0,5	0,3	0,3	0,3	0,4
Наличные поступления, млн. руб.	40	60	70	0	60	100

Пример задач для оценки сформированности компетенции ПК-15

Задача 1

Срок реализации инвестиционного проекта составляет 5 лет, единовременные инвестиционные затраты – 1200 ден. ед., проектная дисконтная ставка – 10%, величина денежного потока постоянна для каждого года реализации проекта.

Необходимо оценить рискованность инвестиционного проекта, если известны следующие данные (табл.1):

Таблица 1 - Исходные данные

Показатель, тыс. ден. ед.	Вероятность наступления события, коэффициент					
	0,02	0,1	0,15	0,25	0,45	0,03
Годовой объем продаж	438,79	455,0	463,0	477,94	496,32	516,69
Годовые издержки на производство и реализацию продукции	220,0	209,82	191,44	180,0	172,0	166,0
Годовой объем амортизации	45,0	45,0	45,0	45,0	45,0	45,0

Задача 2

Имеются пять объектов инвестирования. Величина требуемых капитальных вложений одинакова. Величина планируемого дохода в каждом проекте неопределенна и приведена в виде распределения, представленного в таблице 2.

Определите, какой из проектов предпочтительнее на основе оценки вариации доходов (рассчитайте средневзвешенную доходность и степень однородности доходов) и примете управленческое решение по выбору проекта.

Таблица 2 – Доходы проектов

Проект А		Проект Б		Проект В		Проект Г		Проект Д	
Доход, тыс. руб.	Вероятность	Доход, тыс. руб.	Вероятность	Доход, тыс. руб.	Вероятность	Доход, тыс. руб.	Вероятность	Доход, тыс. руб.	Вероятность
3000	0,10	2000	0,10	1000	0,20	1500	0,25	2000	0,30
3500	0,15	3000	0,25	1500	0,22	2500	0,30	3500	0,15
4000	0,40	4000	0,35	2500	0,20	3000	0,15	4000	0,35
4200	0,20	5000	0,20	4300	0,28	3300	0,22	5300	0,12
5000	0,15	8000	0,10	5500	0,10	4500	0,08	5500	0,08

Полный комплект практических заданий (задач) по темам дисциплины представлен в ФОС (Приложение 3) и практикуме:

Фатхутдинова О.А. Риск - менеджмент: методические указания по проведению практических занятий и организации самостоятельной работы по дисциплине «Риск - менеджмент» для бакалавров направления подготовки 38.03.02 – Менеджмент, направленность (профиль) программы – «Производственный менеджмент» очной формы обучения. – Альметьевск: АГНИ, 2017. – 40 с.

6.3.3. Экзамен

6.3.3.1. Порядок проведения

Тип задания – вопросы к экзамену, задачи. Вопросы к экзамену выдаются студентам заранее. Типовые задачи прорешиваются на практических занятиях. Студент должен дать полный, развернутый и обоснованный ответ на соответствующий вопрос в устной форме, решить задачу. Билет на экзамен включает два теоретических вопроса и одно практическое задание (задачу). Ответ обучающегося оценивается преподавателем в соответствии с установленными критериями.

На экзамене, который проводится в форме компьютерного тестирования, студенту предоставляется блок тестовых заданий, которые генерируются автоматической тестирующей системой персонально в случайном порядке и содержат вопросы и задачи по всему перечню тем дисциплины. Кроме того, студенту предоставляется одно практическое задание, которое необходимо выполнить за компьютером.

6.3.3.2. Критерии оценивания

Баллы в интервале 86-100% от максимальных ставятся, если обучающийся:

- демонстрирует продвинутый уровень владения знаниями, умениями и навыками соответствующих компетенций, что позволяет ему решать широкий круг типовых и нетиповых задач;

- проявил высокую эрудицию и свободное владение материалом дисциплины;

- дал ответы на вопросы четкие, обоснованные и полные, проявил готовность к дискуссии.

Баллы в интервале 71-85% от максимальных ставятся, если обучающийся:

- демонстрирует знания, умения, навыки, сформированные на среднем уровне соответствующих компетенций;

- способен самостоятельно воспроизводить и применять соответствующие знания, умения и навыки для решения типовых задач дисциплины;

- может выполнять поиск и использовать полученную информацию для выполнения новых профессиональных действий;

- дал ответы на вопросы преимущественно правильные, но недостаточно четкие.

Баллы в интервале 55-70% от максимальных ставятся, если обучающийся:

- демонстрирует знания, умения, навыки, сформированные на базовом уровне соответствующих компетенций;

- частично, с помощью извне (например, с использованием наводящих вопросов) может воспроизводить и применять соответствующие знания, умения, навыки;

- дал ответы на вопросы не полные.

Баллы в интервале 0-54% от максимальных ставятся, если обучающийся:

- не ответил на большую часть вопросов;

- демонстрирует полную некомпетентность в материале дисциплины, не способен самостоятельно, без помощи извне, воспроизводить и применять соответствующие знания, умения, навыки.

6.3.3.3. Содержание оценочного средства

Примерные вопросы к экзамену для оценки сформированности компетенций

№	Вопросы к экзамену	ПК-9	ПК-15
1	Сущность и понятие риска.		x
2	Виды рисков, принципы их классификации.		x
3	Функции риска	x	
4	Понятие управления рисками. Риск-менеджмент.		x
5	Взаимосвязь различных рисков.		x
6	Основные этапы управления рисками предприятия: информационная система, аналитическая система, регулирующая система.		x
7	Характеристика основных методов управления и финансирования рисков.		x
8	Методы уклонения от риска.		x
9	Методы локализации риска		x
10	Методы передачи риска.		x
11	Хеджирование как способ передачи риска.		x
12	Методы распределения риска.		x
13	Оценка эффективности диверсификации.	x	
14	Способы компенсации риска.		x
15	Лизинг как способ управления риском.		x
16	Экономико-статистические методы оценки рисков.	x	
17	Экспертные методы оценки рисков.	x	

18	Аналоговые методы оценки рисков.	x	
19	Метод оценки риска «галстук-бабочка»	x	
20	Анализ зон риска		x
21	Разработка мероприятий, осуществляемых при реализации риска.		x
22	Компоненты и элементы системы управления рисками (СУР).		x
23	Идентификация рисков.	x	
24	Алгоритм действий при выявлении рисков		x
25	Определение понятий «рисковое последствие», «рисковое событие».		x
26	Взаимосвязь рискованных последствий и цели.		x
27	Методики определения возможных событий.		x
28	Соотнесение рискованных событий с целью.		x
29	Взаимосвязь целей и событий.		x
30	Определение понятия «рисковый фактор».		x
31	Взаимосвязь рискованных событий и факторов		x
32	Внешние и внутренние факторы.		x
33	Взаимосвязь рискованных факторов, событий и последствий.		x
34	Алгоритм построения сценариев развития рисков.		x
35	Алгоритм построения реестра рисков.		x
36	Понятие кредитного риска в широком и узком смысле слова.		x
37	Формы обеспечения возвратности кредита.		x
38	Основные способы управления кредитным риском.		x
39	Понятие ликвидности. Возникновение риска утраты ликвидности.		x
40	Подходы к управлению ликвидностью.		x
41	Связь риска утраты ликвидности с другими рисками.		x
42	Понятие рыночный риск и основные способы управления рыночными рисками.	x	
43	Валютный риск организации	x	
44	Процентный риск банка.		x
45	Рынок нефти – нестандартные возможности управления ценовыми рисками.	x	
46	Хеджирование как способ страхования рыночных рисков. Эффективное хеджирование.	x	
47	Валютные и процентные СВОПы как инструмент страхования рисков. Основные категории сырьевых активов, подлежащих ценовому хеджированию.		x
48	Операционный риск.		x
49	Юридические, бухгалтерские и налоговые риски.		x
50	Психология принятия рискованных решений.		x

Примерные задачи к экзамену

Задачи для оценки сформированности компетенции ПК-9

Задача 1

Провести оценку риска двух инвестиционных проектов. Первый с вероятностью 0,7 обеспечивает прибыль 150 тыс. руб., однако с вероятностью 0,3 можно потерять 16,7 тыс. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,6 можно получить прибыль 180 тыс. руб. и с вероятностью 0,4 потерять 20,0 тыс. руб. Какой проект выбрать?

Задача 2

Акционерному обществу предлагаются два рискованных проекта (табл. 3).

Учитывая, что фирма имеет долг в 90 млн. руб., какой проект должны выбрать акционеры и почему?

Таблица 3 - Исходные данные проектов

Заданные параметры	Проекты					
	Проект 1			Проект 2		
Вероятность события	0,2	0,5	0,3	0,3	0,3	0,4
Наличные поступления, млн. руб.	40	60	70	0	60	100

Задачи для оценки сформированности компетенции ПК-15

Задача 1

Рассматриваются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,65 обеспечивает доход в 10 млн руб., однако с вероятностью 0,35 убытки могут составить 6 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,7 можно получить доход 8 млн. руб., с вероятностью 0,3 убытки 4 млн. руб. Какой из проектов следует реализовать? Ответ аргументировать.

Задача 2

Стоит ли заменить старое оборудование, нормативный срок службы которого закончился, на новое, если известно, что при использовании старого оборудования прибыль может быть получена по следующей схеме:

$P_1 = 500$ тыс. руб.,

$P_2 = 450$ тыс. руб.,

$P_3 = 320$ тыс. руб.,

$P_4 = 200$ тыс. руб.

Использовании нового оборудования, цена которого 1 млн. руб. и нормативный срок службы 4 года, прибыль может быть получена: $P_1 = 400$ тыс. руб., а последующие 3 года происходит ее увеличение на 30% к предыдущему году. Норма дисконта 12%. Как изменится степень риска, если норма дисконта составит 20%. Ликвидационная стоимость и старого и нового оборудования 200 тыс. руб.

Перечень оценочных средств текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине приведен в Фонде оценочных средств (приложение 3 к данной рабочей программе).

6.4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций

В ГБОУ ВО АГНИ действует балльно-рейтинговая система оценки знаний обучающихся.

Общие положения:

- Для допуска к экзамену студенту необходимо набрать не менее **35 баллов** по результатам текущего контроля знаний.

- Если студент по результатам текущего контроля в учебном семестре набрал от **55 до 60 баллов** и по данной дисциплине предусмотрен экзамен, то по

желанию студента в экзаменационную ведомость и зачетную книжку экзаменатором без дополнительного опроса может быть проставлена оценка «удовлетворительно».

- Выполнение контрольных работ и тестов принимается в установленные сроки.
- Защита практических задач принимается в установленные сроки.
- При наличии уважительных причин срок сдачи может быть продлен, но не более чем на две недели.
- Рейтинговая оценка регулярно доводится до студентов и передается в деканат в установленные сроки.

Порядок выставления рейтинговой оценки:

1. До начала семестра преподаватель формирует рейтинговую систему оценки знаний студентов по дисциплине, с разбивкой по текущим аттестациям.
2. Преподаватель обязан на первом занятии довести до сведения студентов условия рейтинговой системы оценивания знаний и умений по дисциплине.
3. После проведения контрольных испытаний преподаватель обязан ознакомить студентов с их результатами и по просьбе студентов объяснить объективность выставленной оценки.
4. В случае пропусков занятий по неуважительной причине студент имеет право добрать баллы после изучения всех модулей до начала экзаменационной сессии.
5. Студент имеет право добрать баллы во время консультаций, назначенных преподавателем.
6. Преподаватель несет ответственность за правильность подсчета итоговых баллов.
7. Преподаватель не имеет права аннулировать баллы, полученные студентом во время семестра, обязан учитывать их при выведении итоговой оценки.

Распределение рейтинговых баллов по дисциплине

По дисциплине «Риск-менеджмент» предусмотрено два дисциплинарных модуля.

Дисциплинарный модуль	ДМ 5.1	ДМ 5.2
Текущий контроль (практические занятия)	6-10	4-10
Текущий контроль (тестирование)	10-20	15-20
Обще количество баллов	16-30	19-30
Итоговый балл:	35-60	

Дисциплинарный модуль 5.1

№ п/п	Виды работ	Максимальный балл
Текущий контроль		
1	<i>Практическое занятие 1.</i> Определение дополнительного объема финансирования.	2
2	<i>Практическое занятие 2.</i> Выявление последствий реализации рисков событий. Выявление рисков событий, влияющих на	3

	достижение целей. Выявление факторов рисков событий. Классификация перечня рисков событий	
3	<i>Практическое занятие 3.</i> Построение реестра рисков. Качественная оценка рисков. Построение карты рисков. Методы управления рисками. Оценка эффективности мероприятий по управлению рисками. Составление плана реализации мероприятий по управлению рисками.	3
4	<i>Практическое занятие 2.</i> Количественная и качественная оценка риска	2
Итого:		10
Текущий контроль		
1	Тестирование	20
Итого по ДМ 5.1:		30

Дисциплинарный модуль 5.2

№ п/п	Виды работ	Максимальный балл
Текущий контроль		
1	<i>Практическое занятие 5.</i> «Кредитные риски: Понятие, виды и способы управления»	4
2	<i>Практическое занятие 6.</i> Валютный риск организации. Расчет риска открытой валютной позиции и его регулирование	3
3	<i>Практическое занятие 7.</i> Особенности хеджирования с использованием форвардных, фьючерсных и опционных контрактов. Расчет показателей.	3
Итого:		10
Текущий контроль		
1	Тестирование	20
Итого по ДМ 5.2:		30

Студентам могут быть добавлены **дополнительные баллы** за следующие виды деятельности:

- участие в научно-исследовательской работе кафедры (до 7 баллов);
- выступление с докладами (по профилю дисциплины) на конференциях различного уровня (до 5 баллов);
- участие в написании статей с преподавателями кафедры (до 5 баллов).

При этом, если в течение семестра студент набирает более 60 баллов (по результатам дисциплинарных модулей и полученных дополнительных баллов), то итоговая сумма баллов округляется до 60 баллов.

В соответствии с Учебным планом направления подготовки 38.03.02 Менеджмент по дисциплине «Риск-менеджмент» предусмотрен **экзамен в 5 семестре.**

**Критерии оценки знаний студентов
в рамках промежуточной аттестации в форме экзамена проводимого:**

- устно

№ п/п	Структура экзаменационного билета	Максимальный балл
1	Первый теоретический вопрос	15

2	Второй теоретический вопрос	15
3	Практическое задание (решение задачи)	10
Итого		40

- в форме компьютерного тестирования

На экзамене, который проводится в форме компьютерного тестирования, студенту предоставляется блок тестовых заданий в количестве 30 шт., которые генерируются автоматической тестирующей системой персонально в случайном порядке и содержат вопросы по всему перечню тем дисциплины. Каждое правильно выполненное тестовое задание оценивается в 1 балл. Максимальное количество баллов, которое студент имеет возможность набрать – 30.

Кроме того, студенту предоставляется одно практическое задание (решение задачи). Задание оценивается в 10 баллов.

Примеры практических заданий приведены в п. 4.3.2 настоящей рабочей программы.

Таким образом максимальное число баллов за экзамен в тестовой форме – 40.

Для получения экзаменационной оценки общая сумма баллов (за дисциплинарные модули и экзамен) должна составлять от 55 до 100 баллов (см. шкалу перевода рейтинговых баллов).

Шкала перевода рейтинговых баллов

Общее количество набранных баллов	Оценка
55-70	3 (удовлетворительно)
71-85	4 (хорошо)
86-100	5 (отлично)

7. Перечень основной, дополнительной учебной литературы и учебно-методических изданий, необходимых для освоения дисциплины

№ п/п	Библиографическое описание	Количество печатных экземпляров или адрес электронного ресурса	Коэффициент обеспеченности
Основная литература			
1	Балдин К.В. Управление рисками: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления (060000) / К.В. Балдин, С.Н. Воробьев. — М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. - 511с.	Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/71229.html .	1
2	Капустина Е.И. Оценка рисков в проектном менеджменте [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Е.И. Капустина [и др.]. - Электрон. текстовые данные. - Ставрополь: Ставропольский государственный аграрный университет, 2017. - 152 с.	Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/76047.html .	1

	Бондаренко О.Г. Управление коммерческим риском [Электронный ресурс]: учебное пособие для бакалавров/ Бондаренко О.Г., Гришина В.Т.— Электрон. текстовые данные. М.: Дашков и К, 2018. - 148 с	Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85472.html	1
	Фомичев А.Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебник для бакалавров/ Фомичев А.Н.— Электрон. текстовые данные. М.: Дашков и К, 2018. - 372с.	Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85667.html	1
	Шапкин А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций [Электронный ресурс]/ Шапкин А.С., Шапкин В.А.— Электрон. текстовые данные. М.: Дашков и К, 2018. - 544 с.	Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85312.html	1
Дополнительная литература			
1	Пасько Е.А. Риск-менеджмент в корпоративном бизнесе [Электронный ресурс]: курс лекций на английском языке/ Пасько Е.А.— Электрон. текстовые данные. - Ставрополь: СевероКавказский федеральный университет, 2016. - 110 с	Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/69431.html .	1
2	Тепман Л.Н. Управление банковскими рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по направлениям экономики и управления/ Тепман Л.Н., Эриашвили Н.Д.— Электрон. текстовые данные. М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. - 311 с.	Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/81575.html .	1
Учебно-методические издания			
1	Фатхутдинова О.А. Риск - менеджмент: методические указания по проведению практических занятий и организации самостоятельной работы по дисциплине «Риск - менеджмент» для бакалавров направления подготовки 38.03.02 – Менеджмент, направленность (профиль) программы – «Производственный менеджмент» очной формы обучения. – Альметьевск: АГНИ, 2017. – 40 с.	Режим доступа: http://elibrary.agni-rt.ru	1

8. Перечень профессиональных баз данных, информационных справочных систем и информационных ресурсов, необходимых для освоения дисциплины

№ п/п	Наименование	Адрес в Интернете
1	Научно-практический рецензируемый журнал «Вопросы экономики»	https://www.vopreco.ru/jour/index
2	Федеральная служба государственной статистики	www.gks.ru
3	Единое окно доступа к информационным ресурсам	http://window.edu.ru/
4	Российская государственная библиотека	http://www.rsl.ru
5	Электронная библиотека Elibrary	http://elibrary.ru
6	Электронно-библиотечная система IPRbooks	http://iprbookshop.ru
7	Электронная библиотека АГНИ	http://elibrary.agni-rt.ru .

9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Цель методических указаний по освоению дисциплины – обеспечить обучающемуся оптимальную организацию процесса изучения дисциплины, а также выполнения различных форм самостоятельной работы.

Изучение дисциплины обучающимся требует систематического, упорного и последовательного накопления знаний, следовательно, пропуски отдельных тем не позволяют глубоко освоить как пропущенную тему, так и всю дисциплину в целом. Именно поэтому контроль над систематической работой студентов должен находиться в центре внимания преподавателя.

При подготовке к лекционным занятиям (теоретический курс) обучающимся необходимо:

- перед очередной лекцией необходимо изучить по конспекту материал предыдущей лекции, просмотреть рекомендуемую литературу;
- при затруднениях в восприятии материала следует обратиться к основным литературным источникам, рекомендованным рабочей программой дисциплины. Если разобраться в материале самостоятельно не удалось, то следует обратиться к лектору (по графику его консультаций) или к преподавателю на практических занятиях.

При подготовке к практическим занятиям, обучающимся необходимо:

- приносить с собой рекомендованную в рабочей программе литературу к конкретному занятию;
- до очередного практического, занятия по рекомендованным литературным источникам проработать теоретический материал, соответствующей теме;
- теоретический материал следует соотносить с нормативно-справочной литературой, так как в ней могут быть внесены последние научные и практические достижения, изменения, дополнения, которые не всегда отражены в учебной литературе;
- в начале занятий задать преподавателю вопросы по материалу, вызвавшему затруднения в его понимании и освоении при решении задач, заданных для самостоятельного решения;
- на занятии доводить каждую задачу до окончательного решения, демонстрировать понимание проведенных расчетов, в случае затруднений – обращаться к преподавателю.

Обучающимся, пропустившим занятия (независимо от причин), рекомендуется не позже, чем в 2-недельный срок явиться на консультацию к преподавателю и отчитаться по теме, изучавшейся на занятии.

Самостоятельная работа студентов имеет систематический характер и складывается из следующих видов деятельности:

- подготовка ко всем видам контрольных испытаний, в том числе к текущему контролю успеваемости (в течение семестра), промежуточной аттестации (по окончании семестра);
- решение практических задач;
- самостоятельное изучение теоретического материала;
- подготовка к защите практических задач.

Для выполнения указанных видов работ необходимо изучить соответствующие темы теоретического материала, используя конспект лекций, учебники и учебно-методическую литературу, а также интернет-ресурсы.

Перечень учебно-методических изданий, рекомендуемых студентам для подготовки к занятиям и выполнению самостоятельной работы, а также методические материалы на бумажных и/или электронных носителях, выпущенные кафедрой своими силами и предоставляемые студентам во время занятий, представлены в пункте 7 рабочей программы.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в электронно-библиотечной системе «IPRbooks», а также на электронном ресурсе АГНИ (<http://elibrary.agni-rt.ru>), доступ к которым предоставлен студентам.

10. Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование программного обеспечения	Лицензия	Договор
1	Microsoft Office Professional Plus 2016 Rus Academic OLP (Word, Excel, PowerPoint, Access)	№67892163 от 26.12.2016г.	№0297/136 от 23.12.2016г.
2	Microsoft Office Standard 2016 Rus Academic OLP (Word, Excel, PowerPoint)	№67892163 от 26.12.2016г.	№0297/136 от 23.12.2016г.
3	Microsoft Windows Professional 10 Rus Upgrade Academic OLP	№67892163 от 26.12.2016г.	№0297/136 от 23.12.2016г.
4	ABBYY Fine Reader 12 Professional	№197059 от 26.12.2016г.	№0297/136 от 23.12.2016г.
5	Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – Стандартный Russian Edition	№ 24C417120810122125311 38	791 от 30.11.2017
6	Электронно-библиотечная система IPRbooks		Государственный контракт №595 от 30.10.2017г.
7	ПО «Автоматизированная тестирующая система	Свидетельство государственной регистрации программ для ЭВМ №2014614238 от 01.04.2014г.	

11. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по данной дисциплине

Освоение дисциплины «Риск-менеджмент» предполагает использование нижеперечисленного материально-технического обеспечения:

№ п/п	Наименование специальных* помещений и помещений для самостоятельной работы	Оснащенность специальных помещений и помещений для самостоятельной работы
1	Ул. Ленина, 2. Учебный корпус А, аудитория А-203 (учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, практических	1.Компьютер в комплекте с монитором IT Corp 3260 2.Проектор BenQ W1070+

	занятий, групповых и индивидуальных консультаций)	3.Проекционный экран с электроприводом Lumien Master Control
2	Ул. Ленина, 2. Учебный корпус А, аудитория А-318 (учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций)	1. Компьютер в комплекте с монитором с подключением к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду института. 2.Проектор BenQ MX704 3.Экран с электроприводом
3	Ул. Ленина, 2. Учебный корпус А, аудитория А-305 компьютерный класс (учебная аудитория для проведения занятий практического типов, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, самостоятельной работы)	1. Компьютер в комплекте с монитором IT Corp 3250 – 10 шт, с подключением к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду института 2. Проектор SMART V30 3. Интерактивная доска SB480 4. Принтер HP LJ P3015d

*Специальные помещения – учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, практических и лабораторных занятий, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы.

12. Средства адаптации преподавания дисциплины к потребностям обучающихся лиц с ограниченными возможностями здоровья

При необходимости в образовательном процессе применяются следующие методы и технологии, облегчающие восприятие информации обучающимися лицам с ограниченными возможностями здоровья:

- применение дистанционных образовательных технологий для передачи информации, организации различных форм интерактивной контактной работы обучающегося с преподавателем;
- применение дистанционных образовательных технологий для организации форм текущего контроля;
- увеличение продолжительности сдачи обучающимся лицам с ограниченными возможностями здоровья форм промежуточной аттестации по отношению к установленной продолжительности их сдачи:
- продолжительности сдачи зачёта или экзамена, проводимого в письменной форме, - не более чем на 90 минут;
- продолжительности подготовки обучающегося к ответу на зачёте или экзамене, проводимом в устной форме, - не более чем на 20 минут.

Рабочая программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО и учебным планом по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль) программы «Производственный менеджмент».

**АННОТАЦИЯ
рабочей программы дисциплины**

«РИСК – МЕНЕДЖМЕНТ»

Направление подготовки
38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль) программы
«Производственный менеджмент»

Оцениваемые компетенции (код, наименование)	Результаты освоения компетенции	Оценочные средства текущего контроля и промежуточной аттестации
ПК-9 Способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли	знать: – методы анализа, оценки и управления рисками; уметь: – выявлять и анализировать рыночные и специфические риски владеть: – навыками проведения анализа рыночных и специфических рисков	Текущий контроль: Компьютерное тестирование по темам 1-7 Практические задания по темам 1-6 Промежуточная аттестация: Экзамен
ПК-15 Умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	знать: – основную терминологию в области риск-менеджмента, о значении инвестиций на предприятиях реального сектора экономики, финансовых последствиях различных видов риска, о системе риск-менеджмента предприятия уметь: – проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, разрабатывать	Текущий контроль: Компьютерное тестирование по темам 1-7 Практические задания по темам 1-6 Промежуточная аттестация: Экзамен

	мероприятия по управлению рисками проекта владеть: – навыками выполнения анализа рисков и принятия управленческих решений в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании рисков событий.	
--	--	--

Место дисциплины в структуре ОПОП ВО	Б1.В.10 Дисциплина «Риск - менеджмент» является обязательной дисциплиной, входит в состав Блока 1 «Дисциплины (модули)» и относится к вариативной части ОПОП по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль) программы – Производственный менеджмент. Дисциплина изучается на 3 курсе в 5 семестре.
Общая трудоемкость дисциплины (в зачетных единицах и часах)	Зачетных единиц по учебному плану: 3 ЗЕ. Часов по учебному плану: 108 ч.
Виды учебной работы	Контактная работа обучающихся с преподавателем 32 - часа, в том числе: - лекции 15 ч.; - практические занятия 15 ч.; - КСР 2 ч. Самостоятельная работа 40 ч. Контроль (экзамен) – 36 часов.
Изучаемые темы (разделы)	Тема 1. Понятие и классификация рисков Тема 2. Современные подходы к построению интегрированной системы управления рисками компании Тема 3. Методы оценки риска Тема 4. Кредитные риски: понятие, виды и способы управления Тема 5. Понятие и виды рыночных рисков Тема 6. Сущность и инструменты хеджирования Тема 7. Операционный риск
Форма промежуточной аттестации	Экзамен в 5 семестре



ЛИСТ ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ
к рабочей программе дисциплины Б1.В.10
«РИСК – МЕНЕДЖМЕНТ»

Направление подготовки: 38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль) программы: Производственный менеджмент

на 2019/2020 учебный год

В рабочую программу вносятся следующие изменения:

1. В п. 7 **Перечень основной, дополнительной учебной литературы и учебно-методических изданий, необходимых для освоения дисциплины** внесены изменения в подпункт **Дополнительная литература** следующего содержания:

№ п/п	Библиографическое описание	Количество печатных экземпляров или адрес электронного ресурса	Коэффициент обеспеченности
Дополнительная литература			
1.	Балдин К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С. Электрон. текстовые данные. М.: Дашков и К, 2019. - 418 с.	Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85180.html	1

2. В п. 10 **Перечень программного обеспечения** внесены изменения следующего содержания:

Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – Стандартный Russian Edition	№24C4-181023-142527-330-872	№ 591/ВР00181210-СТ от 04.10.2018 г.
Электронно-библиотечная система IPRbooks		Государственный контракт № 578 от 07.11.2018 г.

Изменения в рабочей программе рассмотрены и одобрены на заседании
кафедры экономики и управления предприятием
(наименование кафедры)

протокол № 12 от " 19 " 06 20 19 г.

Заведующий кафедрой:

экономики и управления предприятием
наименование кафедры


подпись

Р.Ш. Садыкова
Ф.И.О.



ЛИСТ ВНЕСЕНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ
к рабочей программе дисциплины Б1.В.10
«РИСК – МЕНЕДЖМЕНТ»

Направление подготовки: 38.03.02 – Менеджмент

Направленность (профиль) программы: Производственный менеджмент

на 2020/2021 учебный год

В рабочую программу вносятся следующие изменения:

1. В п. 7 **Перечень основной, дополнительной учебной литературы и учебно-методических изданий, необходимых для освоения дисциплины** внесены изменения в Электронно-образовательные ресурсы следующего содержания:

№ п/п	Библиографическое описание	Количество печатных экземпляров или адрес электронного ресурса	Коэффициент обеспеченности
Электронно-образовательные ресурсы			
1.	Фатхутдинова О.А. Электронно-образовательный ресурс «Риск-менеджмент»	http://www.mdl.agni-rt.ru	1

2. В п. 9 **Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины** добавлено:

Для изучения дисциплины также, используется система дистанционного обучения АГНИ «Цифровой университет» (СДО АГНИ), созданная на платформе MOODLE, которая позволяет организовать контактную работу обучающихся посредством сети «Интернет» в удаленном режиме доступа. При этом трудоемкость дисциплины и контактной работы, материалы, используемые

для проведения занятий, соответствуют учебному плану, РПД и позволяют полностью освоить заданные компетенции. Вид и форма лекционного материала и материала для практических занятий определяется преподавателем и размещается в СДО АГНИ «Цифровой университет».

3. В п. 10 Перечень программного обеспечения внесены изменения следующего содержания:

Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – Стандартный Russian Edition	№ 24С4191023143020830784	ВР00347095-СТ/582 от 10.10.2019
Электронно-библиотечная система IPRbooks		Лицензионный договор №494 от 01.10.2019г.

Изменения в рабочей программе рассмотрены и одобрены на заседании кафедры экономики и управления предприятием

(наименование кафедры)

протокол № 9 от "17" 06 20 20 г.

Заведующий обеспечивающей кафедрой:

экономики и управления предприятием

наименование кафедры


подпись

Р.Р. Садыкова
Ф.И.О.