МИНОБРНАУКИ РОССИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный технический университет»
(ФГБОУ ВО «СамГТУ»)

УТВЕРЖДАЮ:
Проректор по учебной работе
_____ / О.В. Юсупова
"_____" _____ 20___ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.01.08 «Риск-менеджмент»

Код и направление подготовки (специальность)	38.03.02 Менеджмент
Направленность (профиль)	Экономика и управление на предприятиях топливно-энергетического комплекса
Квалификация	Бакалавр
Форма обучения	Очно-Заочная
Год начала подготовки	2022
Институт / факультет	Институт инженерно-экономического и гуманитарного образования
Выпускающая кафедра	кафедра "Экономика промышленности и производственный менеджмент"
Кафедра-разработчик	кафедра "Экономика промышленности и производственный менеджмент"
Объем дисциплины, ч. / з.е.	180 / 5
Форма контроля (промежуточная аттестация)	Экзамен

Самара 2022

Б1.В.01.08 «Риск-менеджмент»

Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки (специальности) **38.03.02 Менеджмент**, утвержденного приказом Министерства образования и науки РФ от № 970 от 12.08.2020 и соответствующего учебного плана.

Разработчик РПД:

Доцент, кандидат экономических наук, доцент	Е.Г Сафронов
(должность, степень, ученое звание)	(ФИО)
Заведующий кафедрой	О.С. Чечина, доктор экономических наук, профессор
	(ФИО, степень, ученое звание)

СОГЛАСОВАНО:

Председатель методического совета факультета / института (или учебно-методической комиссии)	П.Г Лабзина, кандидат педагогических наук, доцент
	(ФИО, степень, ученое звание)
Руководитель образовательной программы	О.С. Чечина, доктор экономических наук, профессор
	(ФИО, степень, ученое звание)

Содержание

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы 4
2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы 4
3. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся 4
4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам), с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий 5
4.1 Содержание лекционных занятий 5
4.2 Содержание лабораторных занятий 6
4.3 Содержание практических занятий 6
4.4. Содержание самостоятельной работы 7
5. Перечень учебной литературы и учебно-методического обеспечения по дисциплине (модулю) 12
6. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения 12
7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», профессиональных баз данных, информационно-справочных систем 12
8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю) 13
9. Методические материалы 13
10. Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) 15

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

Наименование категории (группы) компетенций	Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения (знать, уметь, владеть, соотнесенные с индикаторами достижения компетенции)
Профессиональные компетенции			
Не предусмотрено	ПК-5 Способен определять и обосновывать цену совершения сделки купли-продажи на энергетическом рынке	ПК-5.2 Оценивает риски макро- и микросреды, влияющие на совершение сделок на энергетическом рынке	Владеть навыками анализа геополитических, ценовых, валютных и прочих рисков в сфере торговли углеводородным сырьем и продуктами его переработки
			Знать возможные риски, влияющие на совершение сделок на энергетическом рынке
			Уметь выявлять риски в сфере торговли углеводородным сырьем и продуктами его переработки

2. Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы: **часть, формируемая участниками образовательных отношений**

Код компетенции	Предшествующие дисциплины	Параллельно осваиваемые дисциплины	Последующие дисциплины
ПК-5			Анализ и прогноз конъюнктуры товарно-промышленных (энергетических) рынков; Выполнение и защита выпускной квалификационной работы; Управление затратами и ценообразование

3. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	Всего часов / часов в электронной форме	7 семестр часов / часов в электронной форме
Аудиторная контактная работа (всего), в том числе:	24 / 24	24 / 24
Лекции	12 / 12	12 / 12
Практические занятия	12 / 12	12 / 12
Внеаудиторная контактная работа, КСР	4	4
Самостоятельная работа (всего), в том числе:	134	134
подготовка к зачету	20	20
подготовка к практическим занятиям	64	64
составление конспектов	50	50
Контроль	18	18
Итого: час	180	180
Итого: з.е.	5	5

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

№ раздела	Наименование раздела дисциплины	Виды учебной нагрузки и их трудоемкость, часы				
		ЛЗ	ЛР	ПЗ	СРС	Всего часов
1	Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	6	0	6	67	79
2	Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	6	0	6	67	79
	КСР	0	0	0	0	4
	Контроль	0	0	0	0	18
	Итого	12	0	12	134	180

4.1 Содержание лекционных занятий

№ занятия	Наименование раздела	Тема лекции	Содержание лекции (перечень дидактических единиц: рассматриваемых подтем, вопросов)	Количество часов / часов в электронной форме
7 семестр				

1	Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	Риск как экономическая категория, его сущность и содержание	Понятие риска, его основные элементы и черты. Понятие риска. Риски в окружающем нас мире. Риск и неопределенность. Объективное и субъективное понимание риска.	2 / 2
2	Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	Риск как экономическая категория, его сущность и содержание	Структурные характеристики риска. Экономические риски. Определение экономического риска. Сущность хозяйственного риска. Предмет, объекты и субъекты хозяйственного риска.	2 / 2
3	Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	Риск-менеджмент в организации	Система управления риском. Развитие концепции управления риском. Общая характеристика системы управления риском. Свойства системы управления риском.	2 / 2
4	Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	Показатели оценки предпринимательского риска	Задачи идентификации и прогнозирования рисков в предпринимательской деятельности. Анализ априорной информации о рискованной деятельности.	2 / 2
5	Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	Показатели оценки предпринимательского риска	Основные технологии исследования предпринимательских рисков. Технический анализ рынка ценных бумаг. Фундаментальный анализ фондового рынка.	2 / 2
6	Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	Критерии принятия рискового решения в предпринимательской деятельности	Учет риска при принятии управленческого решения. Система критериев принятия рискового решения. Критерии принятия решения в условиях неопределенности.	2 / 2
			Итого за семестр:	**12 / 12**
			Итого:	**12 / 12**

4.2 Содержание лабораторных занятий

Учебные занятия не реализуются.

4.3 Содержание практических занятий

№ занятия	**Наименование раздела**	**Тема практического занятия**	**Содержание практического занятия** (перечень дидактических единиц: рассматриваемых подтем, вопросов)	**Количество часов / часов в электронной форме**
7 семестр				
1	Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	Риск как экономическая категория, его сущность и содержание	Элементы хозяйственного риска, формы их проявления.	2 / 2
2	Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	Риск как экономическая категория, его сущность и содержание	Сущностные черты хозяйственного риска, формы их выражения. Систематизация и классификация хозяйственных рисков.	2 / 2

3	Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	Риск-менеджмент в организации	Аутсорсинг управления риском. Цели и задачи системы управления риском. Цели системы управления риском. Задачи системы управления риском.	2 / 2
4	Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	Показатели оценки предпринимательского риска	Методические подходы к количественной оценке риска. Методы и технологии идентификации поведенческих и природных рисков. Методологические основы анализа хозяйственного риска.	2 / 2
5	Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	Показатели оценки предпринимательского риска	Рациональный риск в комплексе мер эффективного использования ресурсов и совокупного капитала.	2 / 2
6	Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	Критерии принятия рискового решения в предпринимательской деятельности	Мониторинг внешней и внутренней среды предприятия. Факторы внешней среды в риск-менеджменте предприятия. Определяющие факторы внутренней среды в рискованной деятельности предприятия.	2 / 2
			Итого за семестр:	**12 / 12**
			Итого:	**12 / 12**

4.4. Содержание самостоятельной работы

Наименование раздела	**Вид самостоятельной работы**	**Содержание самостоятельной работы** (перечень дидактических единиц: рассматриваемых подтем, вопросов)	**Количество часов**
7 семестр			
Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	Подготовка к практическим занятиям	Понятие риска, его основные элементы и черты. Понятие риска. Риски в окружающем нас мире. Риск и неопределенность. Объективное и субъективное понимание риска. Элементы хозяйственного риска, формы их проявления. Структурные характеристики риска. Экономические риски. Определение экономического риска. Сущность хозяйственного риска. Предмет, объекты и субъекты хозяйственного риска. Сущностные черты хозяйственного риска, формы их выражения. Систематизация и классификация хозяйственных рисков. Система управления риском. Развитие концепции управления риском. Общая характеристика системы управления риском. Свойства системы управления риском. Аутсорсинг управления риском. Цели и задачи системы управления риском. Цели системы управления риском. Задачи системы управления риском.	32

Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	составление конспектов	Ограничения системы управления риском. Внешние ограничения системы управления риском. Внутренние ограничения системы управления риском. Прочие принципы управления риском. Поведенческие мотивы менеджеров, предпринимателей в условиях рискованной деятельности. Риски конфликтных ситуаций в хозяйственной деятельности. Предпосылки устойчивого финансового развития субъектов хозяйствования в условиях централизованной и рыночной экономики. Покрытие убытка из текущего дохода. Покрытие убытка из резервов. Покрытие убытка за счет использования займа. Покрытие убытка на основе самострахования. Покрытие убытка на основе страхования. Покрытие убытка на основе нестрахового пула. Покрытие убытка за счет передачи ответственности на основе договора. Покрытие убытка на основе поддержки государственных и/или муниципальных органов. Покрытие убытка на основе спонсорства. Пути снижения экономического риска.	25

Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией	Подготовка к зачету	Понятие риска, его основные элементы и черты. Понятие риска. Риски в окружающем нас мире. Риск и неопределенность. Объективное и субъективное понимание риска. Элементы хозяйственного риска, формы их проявления. Структурные характеристики риска. Экономические риски. Определение экономического риска. Сущность хозяйственного риска. Предмет, объекты и субъекты хозяйственного риска. Сущностные черты хозяйственного риска, формы их выражения. Систематизация и классификация хозяйственных рисков. Система управления риском. Развитие концепции управления риском. Общая характеристика системы управления риском. Свойства системы управления риском. Аутсорсинг управления риском. Цели и задачи системы управления риском. Цели системы управления риском. Задачи системы управления риском.Ограничения системы управления риском. Внешние ограничения системы управления риском. Внутренние ограничения системы управления риском. Прочие принципы управления риском. Поведенческие мотивы менеджеров, предпринимателей в условиях рискованной деятельности. Риски конфликтных ситуаций в хозяйственной деятельности. Предпосылки устойчивого финансового развития субъектов хозяйствования в условиях централизованной и рыночной экономики. Покрытие убытка из текущего дохода. Покрытие убытка из резервов. Покрытие убытка за счет использования займа. Покрытие убытка на основе самострахования. Покрытие убытка на основе страхования. Покрытие убытка на основе нестрахового пула. Покрытие убытка за счет передачи ответственности на основе договора. Покрытие убытка на основе поддержки государственных и/или муниципальных органов. Покрытие убытка на основе спонсорства. Пути снижения экономического риска.	10

Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	Подготовка к практическим занятиям	Задачи идентификации и прогнозирования рисков в предпринимательской деятельности. Анализ априорной информации о рискованной деятельности. Основные технологии исследования предпринимательских рисков. Технический анализ рынка ценных бумаг. Фундаментальный анализ фондового рынка. Учет риска при принятии управленческого решения. Система критериев принятия рискового решения. Критерии принятия решения в условиях неопределенности. Методические подходы к количественной оценке риска. Методы и технологии идентификации поведенческих и природных рисков. Методологические основы анализа хозяйственного риска. Рациональный риск в комплексе мер эффективного использования ресурсов и совокупного капитала. Аутсорсинг управления риском. Цели и задачи системы управления риском. Цели системы управления риском. Задачи системы управления риском.	32
Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	составление конспектов	Критерии принятия решения в условиях стохастической неопределенности. Критерии принятия решения в условиях нестохастической неопределенности. Эвристические правила принятия рискового решения. Основные параметры диагностирования. Этапы диагностики кризиса. Интегрированная система формирования информационной базы в менеджменте риска. Уровни «управляемого интереса» в сложном сочетании рискованной деятельности. Концептуальные подходы менеджмента риска по обеспечению рационального хозяйствования. Модели комплексной оценки и прогнозирования риска финансовой несостоятельности предприятия. Среда прямого и косвенного воздействия на предпринимательскую структуру. Рейтинг странового риска. Макроэкономическая обстановка и характер управленческой деятельности в условиях риска. Предвидение форс-мажорных обстоятельств и управление чистыми рисками. Методы диагностики кризиса. Информация в диагностике.	25

Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса	Подготовка к зачету	Задачи идентификации и прогнозирования рисков в предпринимательской деятельности. Анализ априорной информации о рискованной деятельности. Основные технологии исследования предпринимательских рисков. Технический анализ рынка ценных бумаг. Фундаментальный анализ фондового рынка. Учет риска при принятии управленческого решения. Система критериев принятия рискового решения. Критерии принятия решения в условиях неопределенности. Методические подходы к количественной оценке риска. Методы и технологии идентификации поведенческих и природных рисков. Методологические основы анализа хозяйственного риска. Рациональный риск в комплексе мер эффективного использования ресурсов и совокупного капитала. Аутсорсинг управления риском. Цели и задачи системы управления риском. Цели системы управления риском. Задачи системы управления риском. Критерии принятия решения в условиях стохастической неопределенности. Критерии принятия решения в условиях нестохастической неопределенности. Эвристические правила принятия рискового решения. Основные параметры диагностирования. Этапы диагностики кризиса. Интегрированная система формирования информационной базы в менеджменте риска. Уровни «управляемого интереса» в сложном сочетании рискованной деятельности. Концептуальные подходы менеджмента риска по обеспечению рационального хозяйствования. Модели комплексной оценки и прогнозирования риска финансовой несостоятельности предприятия. Среда прямого и косвенного воздействия на предпринимательскую структуру. Рейтинг странового риска. Макроэкономическая обстановка и характер управленческой деятельности в условиях риска. Предвидение форс-мажорных обстоятельств и управление чистыми рисками. Методы диагностики кризиса. Информация в диагностике.	10
		Итого за семестр:	**134**
		Итого:	**134**

5. Перечень учебной литературы и учебно-методического обеспечения по дисциплине (модулю)

№ п/п	Библиографическое описание	Ресурс НТБ СамГТУ (ЭБС СамГТУ, IPRbooks и т.д.)
Основная литература		
1	Абчук, В.А. Риски в бизнесе,менеджменте и маркетинге / В. А. Абчук.- СПб., Изд-во Михайлова В.А., 2006.- 476 с.	Электронный ресурс
2	Малашихина, Н.Н. Риск-менеджмент : учеб.пособие / Н. Н. Малашихина, О. С. Белокрылова.- Ростов н/Д, Феникс, 2004.- 317 с.	Электронный ресурс
3	Риск-менеджмент инвестиционного проекта : учеб. для студ. вузов, обуч. по экон. спец. [Текст] / под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина.- Москва, ЮНИТИ-ДАНА, 2009.- 544 с.	Электронный ресурс
Дополнительная литература		
4	Фомичев, Андрей Николаевич Риск-менеджмент : учеб.пособие [Текст] .- 2-е изд..- Москва, Издат.-торг.корпорация "Дашков и К", 2006.- 291с.	Электронный ресурс
5	Энциклопедия финансового риск-менеджмента / ред.: А. А. Лобанов, А. В. Чугунов .- 3-е изд..- М., Альпина Бизнес Букс, 2007.- 877 с.	Электронный ресурс

Доступ обучающихся к ЭР НТБ СамГТУ (elib.samgtu.ru) осуществляется посредством электронной информационной образовательной среды университета и сайта НТБ СамГТУ по логину и паролю.

6. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения

При проведении лекционных занятий используется мультимедийное оборудование.

Организовано взаимодействие обучающегося и преподавателя с использованием электронной ин-формационной образовательной среды университета.

№ п/п	Наименование	Производитель	Способ распространения
1	Microsoft Office 2007 Open License Academic	Microsoft (Зарубежный)	Лицензионное
2	Microsoft Windows XP Professional операционная система	Microsoft (Зарубежный)	Лицензионное

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», профессиональных баз данных, информационно-справочных систем

№ п/п	Наименование	Краткое описание	Режим доступа
1	«MD-Менеджмент»: все об управлении	http://www.md-management.ru	Ресурсы открытого доступа
2	AUP.Ru - Электронная библиотека по вопросам экономики, финансов, менеджмента и маркетинга	http://www.aup.ru/	Ресурсы открытого доступа

3	База научных публикаций	2. http://www.spe.org/index.php	Ресурсы открытого доступа
4	Библиотека экономической и управленческой литературы	www zipsites. ru	Ресурсы открытого доступа
5	ScienceDirect (Elsevier) - естественные науки, техника, медицина и общественные науки.	http://www.sciencedirect.com/	Зарубежные базы данных ограниченного доступа

8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Лекционные занятия

Аудитория, оснащенная мультимедийным оборудованием, в том числе компьютером или ноутбуком, проектором и экраном для демонстрации; мебелью для студентов и преподавателя (столы, стулья, доска).

Практические занятия

Аудитория, оснащенная мультимедийным оборудованием, в том числе компьютером или ноутбуком, проектором и экраном для демонстрации; мебелью для студентов и преподавателя (столы, стулья, доска).

Самостоятельная работа

9. Методические материалы

Методические рекомендации при работе на лекции

До лекции студент должен просмотреть учебно-методическую и научную литературу по теме лекции с тем, чтобы иметь представление о проблемах, которые будут разбираться в лекции.

Перед началом лекции обучающимся сообщается тема лекции, план, вопросы, подлежащие рассмотрению, доводятся основные литературные источники. Весь учебный материал, сообщаемый преподавателем, должен не просто прослушиваться. Он должен быть активно воспринят, т.е. услышан, осмыслен, понят, зафиксирован на бумаге и закреплен в памяти. Приступая к слушанию нового учебного материала, полезно мысленно установить его связь с ранее изученным. Следя за техникой чтения лекции (акцент на существенном, повышение тона, изменение ритма, пауза и т.п.), необходимо вслед за преподавателем уметь выделять основные категории, законы и определять их содержание, проблемы, предполагать их возможные решения, доказательства и выводы. Осуществляя такую работу, можно значительно облегчить себе понимание учебного материала, его конспектирование и дальнейшее изучение.

Конспектирование лекции позволяет обработать, систематизировать и лучше сохранить полученную информацию с тем, чтобы в будущем можно было восстановить в памяти основные, содержательные моменты. Типичная ошибка, совершаемая обучающимся, дословное конспектирование речи преподавателя. Как правило, при записи «слово в слово» не остается времени на обдумывание, анализ и синтез информации. Отбирая нужную информацию, главные мысли, проблемы, решения и выводы, необходимо сокращать текст, строить его таким образом, чтобы потом можно было легко в нем разобраться. Желательно оставить в рабочих конспектах поля, на которых можно будет делать пометки из рекомендованной литературы, дополняющие материал прослушанной лекции, а также подчеркивающие особую важность тех или иных теоретических положений. С окончанием лекции работа над конспектом не может считаться завершенной. Нужно еще восстановить отдельные места, проверить, все ли понятно, уточнить что-то на консультации и т.п. с тем, чтобы конспект мог быть использован в процессе подготовки к практическим занятиям, зачету, экзамену. Конспект лекции – незаменимый учебный документ, необходимый для самостоятельной работы.

Методические рекомендации при подготовке и работе на практическом занятии

Практические занятия по дисциплине проводятся в целях выработки практических умений и приобретения навыков в решении профессиональных задач.

Рекомендуется следующая схема подготовки к практическому занятию:

1. ознакомление с планом практического занятия, который отражает содержание предложенной темы;
2. проработка конспекта лекции;
3. чтение рекомендованной литературы;
4. подготовка ответов на вопросы плана практического занятия;
5. выполнение тестовых заданий, задач и др.

Подготовка обучающегося к практическому занятию производится по вопросам, разработанным для каждой темы практических занятий и (или) лекций. В процессе подготовки к практическим занятиям, необходимо обратить особое внимание на самостоятельное изучение рекомендованной литературы.

Работа студентов во время практического занятия осуществляется на основе заданий, которые выдаются обучающимся в начале или во время занятия. На практических занятиях приветствуется активное участие в обсуждении конкретных ситуаций, способность на основе полученных знаний находить наиболее эффективные решения поставленных проблем, уметь находить полезный дополнительный материал по тематике занятий. Обучающимся необходимо обращать внимание на основные понятия, алгоритмы, определять практическую значимость рассматриваемых вопросов. На практических занятиях обучающиеся должны уметь выполнить расчет по заданным параметрам или выработать определенные решения по обозначенной проблеме. Задания могут быть групповые и индивидуальные. В зависимости от сложности предлагаемых заданий, целей занятия, общей подготовки обучающихся преподаватель может подсказать обучающимся алгоритм решения или первое действие, или указать общее направление рассуждений. Полученные результаты обсуждаются с позиций их адекватности или эффективности в рассмотренной ситуации.

Методические рекомендации по выполнению самостоятельной работы

Организация самостоятельной работы обучающихся ориентируется на активные методы овладения знаниями, развитие творческих способностей, переход от поточного к индивидуализированному обучению с учетом потребностей и возможностей обучающегося.

Самостоятельная работа с учебниками, учебными пособиями, научной, справочной литературой, материалами периодических изданий и Интернета является наиболее эффективным методом получения дополнительных знаний, позволяет значительно активизировать процесс овладения информацией, способствует более глубокому усвоению изучаемого материала. Все новые понятия по изучаемой теме необходимо выучить наизусть и внести в глоссарий, который целесообразно вести с самого начала изучения курса.

Самостоятельная работа реализуется:

- непосредственно в процессе аудиторных занятий;
- на лекциях, практических занятиях;
- в контакте с преподавателем вне рамок расписания;
- на консультациях по учебным вопросам, в ходе творческих контактов, при ликвидации задолженностей, при выполнении индивидуальных заданий и т.д.;
- в библиотеке, дома, на кафедре при выполнении обучающимся учебных и практических задач.

Эффективным средством осуществления обучающимся самостоятельной работы является электронная информационно-образовательная среда университета, которая обеспечивает доступ к учебным планам, рабочим программам дисциплин (модулей), практик, к изданиям электронных библиотечных систем.

10. Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю)

Фонд оценочных средств представлен в приложении № 1.

Приложение 1 к рабочей программе дисциплины
Б1.В.01.08 «Риск-менеджмент»

Фонд оценочных средств
по дисциплине
Б1.В.01.08 «Риск-менеджмент»

Код и направление подготовки (специальность)	38.03.02 Менеджмент
Направленность (профиль)	Экономика и управление на предприятиях топливно-энергетического комплекса
Квалификация	Бакалавр
Форма обучения	Очно-Заочная
Год начала подготовки	2022
Институт / факультет	Институт инженерно-экономического и гуманитарного образования
Выпускающая кафедра	кафедра "Экономика промышленности и производственный менеджмент"
Кафедра-разработчик	кафедра "Экономика промышленности и производственный менеджмент"
Объем дисциплины, ч. / з.е.	180 / 5
Форма контроля (промежуточная аттестация)	Экзамен

Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Наименование категории (группы) компетенций	Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения (знать, уметь, владеть, соотнесенные с индикаторами достижения компетенции)
Профессиональные компетенции			
Не предусмотрено	ПК-5 Способен определять и обосновывать цену совершения сделки купли-продажи на энергетическом рынке	ПК-5.2 Оценивает риски макро- и микросреды, влияющие на совершение сделок на энергетическом рынке	Владеть навыками анализа геополитических, ценовых, валютных и прочих рисков в сфере торговли углеводородным сырьем и продуктами его переработки
			Знать возможные риски, влияющие на совершение сделок на энергетическом рынке
			Уметь выявлять риски в сфере торговли углеводородным сырьем и продуктами его переработки

Матрица соответствия оценочных средств запланированным результатам обучения

Код индикатора достижения компетенции	Результаты обучения	Оценочные средства	Текущий контроль успеваемости	Промежуточная аттестация
Механизм обеспечения управления рисками как элемент процессного управления организацией				
ПК-5.2 Оценивает риски макро- и микросреды, влияющие на совершение сделок на энергетическом рынке	**Владеть** навыками анализа геополитических, ценовых, валютных и прочих рисков в сфере торговли углеводородным сырьем и продуктами его переработки	Тестирование	Да	Нет
		Экзамен	Нет	Да
	Знать возможные риски, влияющие на совершение сделок на энергетическом рынке	Тестирование	Да	Нет
		Экзамен	Нет	Да
	Уметь выявлять риски в сфере торговли углеводородным сырьем и продуктами его переработки	Тестирование	Да	Нет
		Экзамен	Нет	Да
Прикладные аспекты риск-менеджмента организации как кроссфункционального процесса				

ПК-5.2 Оценивает риски макро- и микросреды, влияющие на совершение сделок на энергетическом рынке	**Знать** возможные риски, влияющие на совершение сделок на энергетическом рынке	Тестирование	Да	Нет
		Экзамен	Нет	Да
	Владеть навыками анализа геополитических, ценовых, валютных и прочих рисков в сфере торговли углеводородным сырьем и продуктами его переработки	Тестирование	Да	Нет
		Экзамен	Нет	Да
	Уметь выявлять риски в сфере торговли углеводородным сырьем и продуктами его переработки	Тестирование	Да	Нет
		Экзамен	Нет	Да

Перечень вопросов к экзамену
по дисциплине «Риск-менеджмент»

1. Задачи идентификации и прогнозирования рисков в предпринимательской деятельности
2. Анализ априорной информации о рискованной деятельности
3. Основные технологии исследования предпринимательских рисков
4. Технический анализ рынка ценных бумаг
5. Фундаментальный анализ фондового рынка
6. Концептуальные подходы менеджмента риска по обеспечению рационального хозяйствования
7. Модели комплексной оценки и прогнозирования риска финансовой несостоятельности предприятия
8. Метод снижения частоты ущерба или предотвращения убытка
9. Метод уменьшения размера убытков
10. Метод разделения риска
11. Метод аутсорсинга риска
12. Методы финансирования рисков
13. Экспертные процедуры и методы субъективных оценок при измерении риска
14. Характеристика экспертных процедур
15. Общая схема экспертизы
16. Методы трансформации рисков
17. Метод отказа от риска
18. Классификация ошибок персонала в ситуациях риска
19. Типы людей в зависимости от склонности человека к риску
20. Активизация и мотивация работников в условиях неопределенности и риска
21. Формирование кадрового потенциала предприятия в условиях риска
22. Предпосылки и осуществление рискованных решений и действий
23. Человеческая деятельность как источник риска

24. Основные принципы управления рисками
25. Управление риском как часть общего менеджмента фирмы
26. Управление риском и стратегия развития фирмы
27. Управление риском и организационная структура общего менеджмента
28. Система управления риском
29. Развитие концепции управления риском
30. Общая характеристика системы управления риском
31. Свойства системы управления риском
32. Структурные характеристики риска
33. Экономические риски
34. Определение экономического риска
35. Сущность хозяйственного риска
36. Предмет, объекты и субъекты хозяйственного риска
37. Понятие риска, его основные элементы и черты
38. Риски в окружающем нас мире
39. Риск и неопределенность
40. Объективное и субъективное понимание риска

Тестовые задания

1. Идентификация риска – это:

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия;

б) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик;

в) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты.

2. Определите, что подразумевается под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков:

а) страховой тариф;

б) страховая сумма;

в) страховая премия.

3. Какие риски могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль?

а) чистые;

б) критические;

в) спекулятивные.

4. Риски по уровню финансовых потерь делятся на:

а) допустимый, критический и катастрофический;

б) недопустимый, допустимый и критический;

в) критический, катастрофический и недопустимый.

5. Вид риска, к которому относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент:

а) экономический;

б) предпринимательский;

в) политический.

6. Подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных спецификой климатических условий, а также наличием природных ресурсов:

а) природно-климатические;

б) антропогенные;

в) социально-бытовые.

7. … риски – такие риски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря прибыли:

а) катастрофические;

б) критические;

в) допустимые.

8. Укажите, чем измеряется величина или степень риска:

а) средним ожидаемым значением;

б) изменчивостью возможного результата;

в) оба варианта верны.

9. Социально-экономическая функция риска состоит в следующем:

а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике – отрасли деятельности, в которых риск приемлем;

б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода;

в) оба варианта верны.

10. Выделите метод оценки риска, используемый в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий:

а) имитационное моделирование;

б) вероятностный метод;

в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;

г) построение дерева решений;

д) анализ чувствительности;

е) метод сценариев.

11. Отметьте метод оценки риска, представляющий собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты:

а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости;

б) анализ чувствительности;

в) построение дерева решений;

г) вероятностный метод;

д) метод сценариев;

е) имитационное моделирование.

12. Субъект управления в риск-менеджменте – это:

а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками;

б) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами;

в) все варианты верны.

13. Объектом управления в риск-менеджменте выступает:

а) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами;

б) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками;

в) все варианты верны.

14. «Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов». В чем смысл этой фразы?:

а) закон прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов;

б) закон неизбежности риска;

в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод.

15. Выберите методы, к которым относится обучение и инструктирование персонала:

а) методы уклонения от рисков;

б) методы компенсации рисков;

в) методы диверсификации рисков;

г) методы локализации рисков.

16. Определение термина «риск»:

а) разновидность ситуации, объективно содержащей высокую вероятность невозможности осуществления цели;

б)наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна;

в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера.

17. Что из перечисленного относится к потерям времени?:

а) невыполнение сроков сдачи объекта;

б) потери ценных бумаг;

в) выплата штрафа;

г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию;

д) уплата дополнительных налогов.

18. Процесс использования механизмов уменьшения рисков называется:

а) диверсификация;

б) лимитирование;

в) хеджирование.

19. Анализ риска подразумевает под собой следующее:

а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия;

б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты;

в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик.

20. Что является принципом действия механизма диверсификации:

а) избежание рисков;

б) разделение рисков;

в) снижение рисков.

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

Описание шкал оценивания

Процедура оценивания представлена в таблице 1 и реализуется поэтапно:

1-й этап процедуры оценивания: оценивание уровня достижения каждого из запланированных результатов обучения – дескрипторов (знаний, умений, владений) в соответствии со шкалами и критериями, установленными картами компетенций ОПОП (Приложение 1 ОПОП). Экспертной оценке преподавателя подлежит сформированность отдельных дескрипторов, для оценивания которых предназначена данная оценочная процедура текущего контроля и промежуточной аттестации согласно матрице соответствия оценочных средств результатам обучения.

2-й этап процедуры оценивания: интегральная оценка достижения обучающимся запланированных результатов обучения по итогам отдельных видов текущего контроля и промежуточной аттестации.

Таблица 1

Характеристика процедуры промежуточной аттестации по дисциплине

№	Наименование оценочного средства	Периодичность и способ проведения процедуры	Методы оценивания	Виды выставляемых оценок	Способ учета индивидуальных достижений,
1	Опрос	Систематически на практических занятиях (устно)	Экспертный	По пятибалльной шкале	рабочая книжка преподавателя
2	Тестирование	По окончании изучения разделов (письменно)	Экспертный	По пятибалльной шкале	рабочая книжка преподавателя
6	Экзамен	По окончании изучения курса	Экспертный	По пятибалльной шкале	ведомость, зачетная книжка и учебная карточка, индивидуальный план

Шкала и процедура оценивания сформированности компетенций

На этапе промежуточной аттестации используется система оценки успеваемости обучающихся, которая позволяет преподавателю оценить уровень освоения материала обучающимися. Критерии оценивания сформированности планируемых результатов обучения (дескрипторов) представлены в карте компетенции ОПОП.

Форма оценки знаний: оценка - 5 «отлично»; 4 «хорошо»; 3 «удовлетворительно»; 2 «неудовлетворительно».

Шкала оценивания

«Отлично» – выставляется, если сформированность заявленных дескрипторов компетенций *80%* более (в соответствии с картами компетенций ОПОП) оценивается критериями «хорошо» и «отлично», при условии отсутствия оценки «неудовлетворительно»: студент показал прочные знания основных положений фактического материала, умение самостоятельно решать конкретные практические задачи повышенной сложности, свободно использовать справочную литературу, делать обоснованные выводы из результатов анализа конкретных ситуаций;

«Хорошо» – выставляется, если сформированность заявленных дескрипторов компетенций на *70%* и более (в соответствии с картами компетенций ОПОП) оценивается критериями «хорошо» и «отлично», при условии отсутствия оценки «неудовлетворительно», допускается оценка «удовлетворительно»: обучающийся показал

прочные знания основных положений фактического материала, умение самостоятельно решать конкретные практические задачи, предусмотренные рабочей программой, ориентироваться в рекомендованной справочной литературе, умеет правильно оценить полученные результаты анализа конкретных ситуаций;

«Удовлетворительно» – выставляется, если сформированность заявленных дескрипторов компетенций *50%* и более (в соответствии с картами компетенций ОПОП) оценивается критериями «удовлетворительно», «хорошо» и «отлично»: обучающийся показал знание основных положений фактического материала, умение получить с помощью преподавателя правильное решение конкретной практической задачи из числа предусмотренных рабочей программой, знакомство с рекомендованной справочной литературой;

«Неудовлетворительно» – выставляется, если сформированность заявленных дескрипторов компетенций менее чем *50%* (в соответствии с картами компетенций ОПОП) оценивается критериями «удовлетворительно», «хорошо» и «отлично»: при ответе обучающегося выявились существенные пробелы в знаниях основных положений фактического материала, неумение с помощью преподавателя получить правильное решение конкретной практической задачи из числа предусмотренных рабочей программой учебной дисциплины.

Ответы и решения обучающихся оцениваются по следующим общим критериям: распознавание проблем; определение значимой информации; анализ проблем; аргументированность; использование стратегий; творческий подход; выводы; общая грамотность.

Соответствие критериев оценивания сформированности планируемых результатов обучения (дескрипторов) системам оценок представлено в табл. 2

Таблица 2

Интегральная оценка

Критерии	Традиционная оценка
5	5
4	4
3	3
2 и 1	Неудовлет.

Обучающиеся обязаны сдавать все задания в сроки, установленные преподавателем. Оценка «Удовлетворительно» по дисциплине, может выставляться и при неполной сформированности компетенций в ходе освоения отдельной учебной дисциплины, если их формирование предполагается продолжить на более поздних этапах обучения, в ходе изучения других учебных дисциплин.