

АКТУАЛИЗИРОВАНО
Решением Ученого совета ИЦТЭ КГЭУ
Протокол №7 от 19.03.2024



МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
КГЭУ «КАЗАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ЭНЕРГЕТИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»
(ФГБОУ ВО «КГЭУ»)

УТВЕРЖДАЮ

Директор ИЦТЭ

_____ Ю.В. Торкунова

«22» июня 2021 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Управление рисками и моделирование рисков ситуаций

(Наименование дисциплины в соответствии с РУП)

Направление подго-
товки

38.03.01 Экономика

Направленности
(профили)

Бизнес-аналитика и цифровая экономика

Квалификация

Бакалавр

г. Казань, 2021

Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с ФГОС ВО 3++ по направлению подготовки бакалавров 38.03.01 «Экономика», утвержденного Приказом Министерством образования и науки Российской Федерации от 12.08.2020 г. № 954.

Программу разработал(и):

доцент, к.э.н. _____ Хусаинова Е.А.

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры-разработчика ЭОП, протокол №14 от 07.06.2021 г. Заведующий кафедрой Ахметова И.Г.

Программа рассмотрена и одобрена на заседании выпускающей кафедры протокол № 14 от 07.06.2021 г.

Зав. кафедрой ЭОП Ахметова И.Г.

Программа одобрена на заседании учебно-методического совета института Цифровых технологий и экономики, протокол № 10 от 22.06.2021 г.

Зам. директора института Цифровых технологий и экономики Косулин В.В.

Программа принята решением Ученого совета института Цифровых технологий и экономики протокол № 11 от 22.06.2021

Согласовано:

Руководитель ОПОП Ахметова И.Г.

1. Цель, задачи и планируемые результаты обучения по дисциплине

Целью освоения дисциплины «Управление рисками и моделирование рискованных ситуаций» является изучение предмета, объектов, цели и практических навыков в области организации и управления рисками в деятельности хозяйствующих субъектов, разработки экономически эффективных финансовых и инвестиционных решений.

Задачи данной дисциплины заключаются в целенаправленной подготовке специалистов, имеющих представление о роле финансового риска в системе предпринимательских рисков определить его основные характеристики; о экономическом содержании финансовых и предпринимательских рисков; принципах управления финансовыми и предпринимательскими рисками в системе экономической безопасности, рассмотреть базовые концепции финансовой безопасности. Умения направлены на развитие способности формировать правильные суждения на предмет принятия оптимальных финансовых решений в условиях риска и неопределенности.

Компетенции, формируемые у обучающихся, запланированные результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с дескрипторами достижения компетенций:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения по дисциплине (знать, уметь, владеть)
ПК-1 Способен выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, формировать, анализировать и обосновывать возможные решения на основе целевых показателей и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами	ПК-1.3 Способен определять связи и взаимосвязи между элементами информации бизнес-анализа, проводить оценку эффективности решения с точки зрения выбранных критериев с учетом минимизации рисков	<i>Знать:</i> - основные термины и понятия в области моделирования рискованных ситуаций, показатели и их взаимосвязи, используемые для экономико-математического описания задач управления (З ₁); <i>Уметь:</i> - выбирать инструментальные средства для принятия управленческих решений в условиях риска (У ₁); <i>Владеть:</i> -навыками разработки альтернативных вариантов управленческих решений с учетом риска(В ₁).

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Управление рисками и моделирование рискованных ситуаций» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» направленностей (профилей) Бизнес-аналитика и цифровая экономика.

Код компетенции	Предшествующие дисциплины (модули), практики, НИР, др.	Последующие дисциплины (модули), практики, НИР, др.
ПК-1	Основы бизнес-анализа	Прогнозирование и анализ кризисов

Для освоения дисциплины обучающийся должен:

Знать: методы экономического анализа; процесс сбора финансово-экономической и статистической информации; процесс сбора финансово-экономической, статистической информации.

Уметь: собрать и проанализировать данные по функционированию отраслевых рынков; собирать и обобщать информацию для целей ведения анализа рыночных структур; собирать и обобщать информацию необходимую для проведения анализа финансовой сферы.

Владеть: анализом информации об основных финансово-экономических показателях предприятий и отраслей; навыками статистического, сравнительно-финансового анализа для решения вопросов профессиональной деятельности; современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных.

3. Структура и содержание дисциплины

3.1. Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы (ЗЕ), всего 108 часов, из которых 53 часа составляет контактная работа обучающегося с преподавателем (занятия лекционного типа 34 час., занятия семинарского типа (практические, семинарские занятия, лабораторные работы и т.п.) 16 час., групповые и индивидуальные консультации 2 час., КСР-2 часа, прием экзамена (КПА), зачета с оценкой - 1 час., самостоятельная работа обучающегося 38 час.

Вид учебной работы	Всего ЗЕ	Всего часов	Семестр(ы)*	
ОБЩАЯ ТРУДОЕМКОСТЬ ДИСЦИПЛИНЫ	3	108		8
КОНТАКТНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩЕГОСЯ С ПРЕПОДАВАТЕЛЕМ, в том числе:		53		53
Лекции (Лек)		34		34
Практические (семинарские) занятия (Пр)		16		16
КСР		2		2
Групповые консультации				
Индивидуальные консультации				
Сдача экзамена / зачета с оценкой (КПА)		1		1
САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩЕГОСЯ (СРС), в том числе:		38		38
Подготовка к промежуточной аттестации в форме: <i>Зачет с оценкой</i>		17		17
ФОРМА ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ (ЗО-зачет с оценкой)		30		30

3.2. Содержание дисциплины, структурированное по разделам и видам занятий

Разделы дисциплины	Семестр	Распределение трудоемкости (в часах) по видам учебной работы, включая СРС								Формируемые результаты обучения (знания, умения, навыки)	Литература	Формы текущего контроля успеваемости	Формы промежуточной аттестации	Максимальное количество баллов по балльно - рейтинговой системе
		Занятия лекционного типа	Занятия практического / семинарского типа	КСР	Индивидуальные консультации	Самостоятельная работа студента, в т.ч.	подготовка к промежуточной аттестации	Сдача зачета / экзамена	Итого					
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15
<p>Тема 1. Место и роль экономических рисков в управлении деятельностью организации.</p> <p>Лекция 1. Место и роль рисков в экономической деятельности.</p> <p>Лекция 2. Система управления рисками.</p> <p>Лекция 3. Определение степени рисков. Зонирование областей потерь по степени риска. Критерии потерь основных зон риска.</p> <p>Лекция 4. Математические методы оценки экономических рисков</p> <p>Практическое занятие 1. Концепция риска и методы его оценки</p> <p>Практическое занятие 2. Измерение систематического риска, бета-коэффициент</p>	8	8	4			8			20	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	О-1,2,3; Д-1,2	<i>Тест, практическое задание</i>		12
<p>Тема 2. Риски предприятий сферы сервиса</p> <p>Лекция 5. Сервисные технологии.</p> <p>Лекция 6. Классификация рисков предприятий сферы сер-</p>	8	8	4			8			20	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	О-1,2,3,Д	<i>Кейс-задача, тест</i>		12

<p>виса.</p> <p>Лекция 7. Динамический анализ ситуации на рынке услуг.</p> <p>Лекция 8. Картографирование рисков. Построение карты рисков и рискография. Табличное представление информации в разных стандартах по риск-менеджменту</p> <p>Практическое занятие 3. Методы идентификации, измерения и картографирования рисков с использованием Excel.</p> <p>Практические занятия 4. Составление карты рисков различных организаций с применением Excel.</p>											-1			
<p>Тема 3. Риск-менеджмент - система управления риском</p> <p>Лекция 9. Сущность и содержание риск-менеджмента. Разработка программы действий по снижению риска: последовательность стадий. Программное обеспечение для риск-менеджмента (ModelRisk, SIPmath, @Risk, AnyLogic Simulation)</p> <p>Лекция 10. Особенности принятия решений в области риск-менеджмента. Эвристические правила риск-менеджмента и их действие. Коэффициент риска.</p> <p>Лекция 11. Организационные структуры службы риск-менеджмента. Процессный подход к риск-менеджменту в организации.</p> <p>Лекция 12. Внешний и внутренний мониторинг рисков. Планирование в системе риск-менеджмента.</p> <p>Практическое занятие 5. Риск-менеджмент - система управления риском с помощью ModelRisk, SIPmath.</p> <p>Практическое занятие 6. Разработка программы действий по снижению риска: последовательность стадий с помощью @Risk, AnyLogic Simulation.</p>	8	8	4	2	8			22	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	О- 1,2 № Д- 1,2	<i>Тест, практическое задание</i>		12	
<p>Тема 4. Стратегия риск-менеджмента</p> <p>Лекция 13. Понятие стратегии риск-менеджмента. Основные правила стратегии риск - менеджмента и их действие. Принципы управления риском.</p> <p>Лекция 14. Приемы управления риском. Средства разрешения риска (избежание, удержание, передача, сни-</p>	8	8	2		8			18	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	О- 1,2 ;Д- 1,2	<i>Тест, практическое задание</i>		12	

жение степени риска). Лекция 15. Способы снижения риска. Диверсификация. Поиск информации. Асимметрия информации. Лекция 16. Оценка эффективности приобретаемой информации. Лимитирование. Объединение риска. Самострахование. Страхование. Практическое занятие 7. Способы снижения риска													
Тема 5. Методы управления финансовыми рисками Лекция 17. Особенности рынка срочных контрактов и его виды. Фьючерсные контракты. Специфика фьючерсных сделок. Форвардные контракты, их специфика. Форвардный курс. Особенности риска форвардных сделок. Практическое занятие 8. Модель прогноза риска банкротства	8	2	2			6			10	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	О- 1,2 ,3; Д- 1,2	<i>Тест, практическое задание</i>	12
Промежуточная аттестация в форме <i>Зачет с оценкой</i>							17	1	18				40
ИТОГО		34	16	2		38			108				100

3.3. Тематический план лекционных занятий

Номер раздела дисциплины	Темы лекционных занятий	Трудоемкость, час.
1	<p>Место и роль рисков в экономической деятельности. Система управления рисками. Определение степени рисков. Зонирование областей потерь по степени риска. Критерии потерь основных зон риска. Математические методы оценки экономических рисков</p>	8
2	<p>Сервисные технологии. Классификация рисков предприятий сферы сервиса. Динамический анализ ситуации на рынке услуг. Картографирование рисков. Построение карты рисков и рискография. Табличное представление информации в разных стандартах по риск-менеджменту</p>	8
3	<p>Сущность и содержание риск-менеджмента. Разработка программы действий по снижению риска: последовательность стадий. Программное обеспечение для риск-менеджмента (ModelRisk, SIPmath, @Risk, AnyLogic Simulation) Особенности принятия решений в области риск-менеджмента. Эвристические правила риск-менеджмента и их действие. Коэффициент риска. Организационные структуры службы риск-менеджмента. Процессный подход к риск- менеджменту в организации. Внешний и внутренний мониторинг рисков. Планирование в системе риск-менеджмента.</p>	8
4	<p>Понятие стратегии риск-менеджмента. Основные правила стратегии риск - менеджмента и их действие. Принципы управления риском. Приемы управления риском. Средства разрешения риска (избежание, удержание, передача, снижение степени риска). Способы снижения риска. Диверсификация. Поиск информации. Ассиметрия информации. Оценка эффективности приобретаемой информации. Лимитирование. Объединение риска. Самострахование. Страхование.</p>	8
5	<p>Особенности рынка срочных контрактов и его виды. Фьючерсные контракты. Специфика фьючерсных сделок. Форвардные контракты, их специфика. Форвардный курс. Особенности риска форвардных сделок.</p>	2
Всего		34

3.4. Тематический план практических занятий

Номер раздела дисциплины	Темы практических занятий	Трудоемкость, час.
1	Концепция риска и методы его оценки Измерение систематического риска, бета-коэффициент	4
2	Методы идентификации, измерения и картографирования рисков с использованием Excel. Составление карты рисков различных организаций с применением Excel.	4
3	Риск-менеджмент - система управления риском с помощью ModelRisk, SIPmath . Разработка программы действий по снижению риска: последовательность стадий с помощью @Risk, AnyLogic Simulation .	4
4	Способы снижения риска	2
5	Модель прогноза риска банкротства	2
Всего		16

3.6. Самостоятельная работа студента

Номер раздела дисциплины	Вид СРС	Содержание СРС	Трудоемкость, час.
1	Модель ценообразования основных активов (САРМ). Премия риска индивидуального актива.	Подготовка к тестированию	8
2	Построение карты рисков и рискография.	Практическое задание Подготовка к контрольной работе	8
3	Процессный подход к риск-менеджменту в организации.	Подготовка доклада	8
4	Ассиметрия информации.	Подготовка доклада	8
5	Фьючерсные контракты. Специфика фьючерсных сделок.	Подготовка к тестированию	2
Всего			38

4. Образовательные технологии

При проведении учебных занятий используются традиционные образовательные технологии - лекции в сочетании с лабораторными работами, самостоятельное изучение определённых разделов.

В процессе обучения используются дистанционные образовательные технологии и- электронные образовательные ресурсы (ЭОР), размещенные в личных кабинетах студентов Электронного университета КГЭУ, URL: <http://e.kgeu.ru/>, направленные на обеспечение развития у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений.

В образовательном процессе используется:

- дистанционный курс (ДК), размещенный на площадке LMS Moodle, URL:

5. Оценивание результатов обучения

Оценивание результатов обучения по дисциплине осуществляется в рамках текущего контроля успеваемости, проводимого по балльно-рейтинговой системе (БРС), и промежуточной аттестации.

Текущий контроль успеваемости осуществляется в течение семестра, включает: защиты лабораторных работ; проведение компьютерного тестирования.

Итоговой оценкой результатов освоения дисциплины является оценка, выставленная во время промежуточной аттестации обучающегося экзамена с учетом результатов текущего контроля успеваемости. На экзамен выносятся теоретические и практические задания, проработанные в течение семестра на учебных занятиях и в процессе самостоятельной работы обучающихся. Экзаменационные билеты содержат два теоретических заданий и одно заданий практического характера.

Обобщенные критерии и шкала оценивания уровня сформированности компетенции (дескрипторы достижения компетенции) по итогам освоения дисциплины:

Планируемые результаты обучения	Обобщенные критерии и шкала оценивания результатов обучения			
	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично
	не зачтено	зачтено		
Полнота знаний	<i>Уровень знаний ниже минимальных требований, имеют место грубые ошибки</i>	<i>Минимально допустимый уровень знаний, имеет место много негрубых ошибок</i>	<i>Уровень знаний в объеме, соответствующем программе, имеет место несколько негрубых ошибок</i>	<i>Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки, без ошибок</i>
Наличие умений	<i>При решении стандартных задач не продемонстрированы основные умения, имеют место грубые ошибки</i>	<i>Продемонстрированы основные умения, решены типовые задачи с негрубыми ошибками, выполнены все задания, но не в полном объеме</i>	<i>Продемонстрированы все основные умения, решены все основные задачи с негрубыми ошибками, выполнены все задания в полном объеме, но некоторые с недочетами</i>	<i>Продемонстрированы все основные умения, решены все основные задачи с отдельными несущественными недочетами, выполнены все задания в полном объеме</i>
Наличие	<i>При решении</i>	<i>Имеется минималь-</i>	<i>Продемонстрированы</i>	<i>Продемонстриро-</i>

навыков (владение опытом)	<i>стандартных задач не продемонстрированы базовые навыки, имеют место грубые ошибки</i>	<i>ный набор навыков для решения стандартных задач с некоторыми недочетами</i>	<i>базовые навыки при решении стандартных задач с некоторыми недочетами</i>	<i>ваны навыки при решении нестандартных задач без ошибок и недочетов</i>
Характеристика сформированности компетенции (дескриптора достижения компетенции)	<i>Компетенция в полной мере не сформирована. Имеющихся знаний, умений, навыков недостаточно для решения практических (профессиональных) задач</i>	<i>Сформированность компетенции соответствует минимальным требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков в целом достаточно для решения практических (профессиональных) задач, но требуется дополнительная практика по большинству практических задач</i>	<i>Сформированность компетенции в целом соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков и мотивации в целом достаточно для решения стандартных практических (профессиональных) задач</i>	<i>Сформированность компетенции полностью соответствует требованиям. Имеющихся знаний, умений, навыков и мотивации в полной мере достаточно для решения сложных практических (профессиональных) задач</i>
Уровень сформированности компетенции (дескриптора достижения компетенции)	Низкий	Ниже среднего	Средний	Высокий

Шкала оценки результатов обучения по дисциплине:

Код компетенции	Запланированные дескрипторы освоения дисциплины	Уровень сформированности компетенции (дескрипторы достижения компетенции)			
		Высокий	Средний	Ниже среднего	Низкий
		Шкала оценивания			
		отлично	хорошо	удовлетворительно	неудовлетворительно
		зачтено			не зачтено
ПК-1.3 Способен определять связи и зависимости между элементами информации бизнес-анализа, проводить оценку эффективности решения с точки зрения выбранных критериев с учетом минимизации рисков	знать: основные термины и понятия в области моделирования рисков ситуаций, показатели и их взаимосвязи, используемые для экономико-математического описания задач управления (З ₁).	Знает основные термины и понятия в области моделирования рисков ситуаций, показатели и их взаимосвязи, не допускает ошибок	Знает основные термины и понятия в области моделирования рисков ситуаций, показатели и их взаимосвязи, может допустить несколько негрубых ошибок	Знает основные термины и понятия в области моделирования рисков ситуаций, показатели и их взаимосвязи, допускает много мелких ошибок	Уровень знаний ниже минимального, допускает грубые ошибки
	уметь: выбирать инструментальные средства для принятия управленческих решений в условиях риска (У ₁);	умеет выбирать инструментальные средства для принятия управленческих решений в условиях риска, выполнены все задания в полном объеме	умеет выбирать инструментальные средства для принятия управленческих решений в условиях риска, выполнены все задания в полном объеме, но некоторые с недочетами	умеет выбирать инструментальные средства для принятия управленческих решений в условиях риска, решены типовые задачи с негрубыми ошибками, выполнены все задания, но не в полном объеме	При решении стандартных задач не продемонстрированы основные умения, имеют место грубые ошибки
	владеть: навыками разработки альтернативных вариантов управленческих решений с учетом риска (В ₁).	Владеет навыками разработки альтернативных вариантов управленческих решений с учетом риска, решение нестандартных задач без ошибок и недочетов	Владеет навыками разработки альтернативных вариантов управленческих решений с учетом риска, выполнены все задания в полном объеме, с некоторыми недочетами	Владеет навыками разработки альтернативных вариантов управленческих решений с учетом риска, выполнены все задания, но не в полном объеме	При решении стандартных задач не продемонстрированы базовые навыки, имеют место грубые ошибки

Оценочные материалы для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации приведены в Приложении к рабочей программе дисциплины. *Полный комплект заданий и материалов, необходимых для оценивания результатов обучения по дисциплине, хранится на кафедре-разработчике в бумажном и электронном виде.*

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1. Учебно-методическое обеспечение

Основная литература

№ п/п	Автор(ы)	Наименование	Вид издания (учебник, учебное пособие, др.)	Место издания, издательство	Год издания	Адрес электронного ресурса	Кол-во экземпляров в библиотеке КГЭУ
1	Грибов В.Д..	Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски	Учебное пособие	Москва : КноРус— 304с.	2017	URL: https://www.book.ru/book/919988	
2	Тактаров Г.А., Григорьева Е.М.	Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски	Учебное пособие	Москва : КноРус— 255с.	2015	URL: https://book.ru/book/918919	

Дополнительная литература

№ п/п	Автор(ы)	Наименование	Вид издания (учебник, учебное пособие, др.)	Место издания, издательство	Год издания	Адрес электронного ресурса	Кол-во экземпляров в библиотеке КГЭУ
1	Т. В. Струченкова.	Валютные риски: анализ и управление	Учебное пособие	Москва : КноРус— 224с.	2016	URL: https://www.book.ru/book/920593	
2	Качкова О.Е.	Научное обоснование и разработка системы управления рисками для осуществления внутреннего финансового аудита в госу-	монография	Москва : Русайнс— 229с.	2017	URL: https://book.ru/book/923094 .	

		дарственных (муниципальных) учреждений					
--	--	---	--	--	--	--	--

6.2. Информационное обеспечение

6.2.1. Электронные и интернет-ресурсы

№ п/п	Наименование электронных и интернет-ресурсов	Ссылка
1	Электронно-библиотечная система «book.ru»	https://www.book.ru/

6.2.2. Профессиональные базы данных

№ п/п	Наименование профессиональных баз данных	Адрес	Режим доступа
1	Официальный интернет-портал правовой информации	http://pravo.gov.ru	http://pravo.gov.ru
2	Справочная правовая система «Консультант Плюс»	http://consultant.ru	http://consultant.ru
3	Справочно-правовая система по законодательству РФ	http://garant.ru	http://garant.ru

6.2.3. Информационно-справочные системы

№ п/п	Наименование информационно-справочных систем	Адрес	Режим доступа
1	Научная электронная библиотека	http://elibrary.ru	http://elibrary.ru
2	Российская государственная библиотека	http://www.rsl.ru	http://www.rsl.ru
5	Образовательный портал	http://www.uceba.com	http://www.uceba.com

6.2.4. Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение дисциплины

№ п/п	Наименование программного обеспечения	Способ распространения (лицензионное/свободно)	Реквизиты подтверждающих документов
1	LMS Moodle	Современное программное обеспечение	https://lms.kgeu.ru/course/view.php?id=2815
2	Операционная система Windows 7 Профессиональная	лицензионное	Договор ПО ЛИЦ № 0000/20, лицензиар – ЗАО «ТаксНет Сервис»

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины

№ п/п	Вид учебной работы	Описание	Оснащенность специальных помещений и помещений для СРС
1	Лекционные занятия	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа	доска аудиторная, компьютер в комплекте с монитором, проектор, экран
		Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа	интерактивная доска, проектор, процессор, доска аудиторная
2	Практические занятия	Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации	моноблок (15 шт.), проектор, экран
		Компьютерный класс с выходом в Интернет	доска аудиторная, компьютер в комплекте с монитором (15 шт.), проектор, экран
4	Самостоятельная работа обучающегося	Компьютерный класс с выходом в Интернет	<p>1. Windows 7 Профессиональная (Pro): договор №2011.25486 от 28.11.2011, лицензиар – ЗАО «Софт Лайн Трейд», тип (вид) лицензии – неискл. право, срок действия лицензии - бессрочно.</p> <p>2. Office Standard 2007 Russian OLP NL AcademicEdition+: договор №21/2010 от 04.05.2010, лицензиар - ЗАО «Софт Лайн Трейд», тип (вид) лицензии - неискл. право, срок действия лицензии - бессрочно</p> <p>3. Браузер Chrome, LMS Moodle. Свободная лицензия, тип (вид) лицензии - неискл. право, срок действия лицензии - бессрочно.</p> <p>ПО в свободном доступе: Visual Studio 2019 Community, IntelliJ IDEA Community Edition 2019, Python 3.7, PyCharm Community, Sublime Text 3, Denwer, Microsoft SQL Server Tools 18, MySQL WorkBench 8.0 CE, Android Studio, 1С:Предприятие Учебная версия, Arduino, Cisco Packet Tracer, Aris Express, ГИС Zulu 8.0 Инженерные расчеты, Oracle VM Virtual Box. Свободная лицензия, тип (вид) лицензии - неискл. право, срок действия ли-</p>

			цензии - бессрочно.
		Читальный зал библиотеки	Специализированная мебель, компьютерная техника с возможностью выхода в Интернет и обеспечением доступа в ЭИОС, мультимедийный проектор, экран, программное обеспечение

8. Особенности организации образовательной деятельности для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Лица с ограниченными возможностями здоровья (ОВЗ) и инвалиды имеют возможность беспрепятственно перемещаться из одного учебно-лабораторного корпуса в другой, подняться на все этажи учебно-лабораторных корпусов, заниматься в учебных и иных помещениях с учетом особенностей психофизического развития и состояния здоровья.

Для обучения лиц с ОВЗ и инвалидов, имеющих нарушения опорно-двигательного аппарата, обеспечены условия беспрепятственного доступа во все учебные помещения. Информация о специальных условиях, созданных для обучающихся с ОВЗ и инвалидов, размещена на сайте университета www//kgeu.ru. Имеется возможность оказания технической помощи ассистентом, а также услуг сурдопереводчиков и тифлосурдопереводчиков.

Для адаптации к восприятию лицами с ОВЗ и инвалидами с нарушенным слухом справочного, учебного материала по дисциплине обеспечиваются следующие условия:

- для лучшей ориентации в аудитории, применяются сигналы оповещения о начале и конце занятия (слово «звонок» пишется на доске);
- внимание слабослышащего обучающегося привлекается педагогом жестом (на плечо кладется рука, осуществляется нерезкое похлопывание);
- разговаривая с обучающимся, педагогический работник смотрит на него, говорит ясно, короткими предложениями, обеспечивая возможность чтения по губам.

Компенсация затруднений речевого и интеллектуального развития слабослышащих обучающихся проводится путем:

- использования схем, диаграмм, рисунков, компьютерных презентаций с гиперссылками, комментирующими отдельные компоненты изображения;
- регулярного применения упражнений на графическое выделение существенных признаков предметов и явлений;
- обеспечения возможности для обучающегося получить адресную консультацию по электронной почте по мере необходимости.

Для адаптации к восприятию лицами с ОВЗ и инвалидами с нарушениями зрения справочного, учебного, просветительского материала, предусмотренного образовательной программой по выбранному направлению подготовки, обеспечиваются следующие условия:

- ведется адаптация официального сайта в сети Интернет с учетом особых потребностей инвалидов по зрению, обеспечивается наличие крупношрифтовой справочной информации о расписании учебных занятий;

- педагогический работник, его собеседник (при необходимости), присутствующие на занятии, представляются обучающимся, при этом каждый раз называется тот, к кому педагогический работник обращается;

- действия, жесты, перемещения педагогического работника коротко и ясно комментируются;

- печатная информация предоставляется крупным шрифтом (от 18 пунктов), тотально озвучивается;

- обеспечивается необходимый уровень освещенности помещений;

- предоставляется возможность использовать компьютеры во время занятий и право записи объяснений на диктофон (по желанию обучающихся).

Форма проведения текущей и промежуточной аттестации для обучающихся с ОВЗ и инвалидов определяется педагогическим работником в соответствии с учебным планом. При необходимости обучающемуся с ОВЗ, инвалиду с учетом их индивидуальных психофизических особенностей дается возможность пройти промежуточную аттестацию устно, письменно на бумаге, письменно на компьютере, в форме тестирования и т.п., либо предоставляется дополнительное время для подготовки ответа.

9. Методические рекомендации для преподавателей по организации воспитательной работы с обучающимися

Методическое обеспечение процесса воспитания обучающихся выступает одним из определяющих факторов высокого качества образования. Преподаватель вуза, демонстрируя высокий профессионализм, эрудицию, четкую гражданскую позицию, самодисциплину, творческий подход в решении профессиональных задач, в ходе образовательного процесса способствует формированию гармоничной личности.

При реализации дисциплины преподаватель может использовать следующие методы воспитательной работы:

- методы формирования сознания личности (беседа, диспут, внушение, инструктаж, контроль, объяснение, пример, самоконтроль, рассказ, совет, убеждение и др.);

- методы организации деятельности и формирования опыта поведения (задание, общественное мнение, педагогическое требование, поручение, приучение, создание воспитывающих ситуаций, тренинг, упражнение, и др.);

- методы мотивации деятельности и поведения (одобрение, поощрение социальной активности, порицание, создание ситуаций успеха, создание ситуаций для эмоционально-нравственных переживаний, соревнование и др.)

При реализации дисциплины преподаватель должен учитывать следующие направления воспитательной деятельности:

Гражданское и патриотическое воспитание:

- формирование у обучающихся целостного мировоззрения, российской идентичности, уважения к своей семье, обществу, государству, принятым в семье и обществе духовно-нравственным и социокультурным ценностям, к национальному, культурному и историческому наследию, формирование стремления к его сохранению и развитию;

- формирование у обучающихся активной гражданской позиции, основанной на традиционных культурных, духовных и нравственных ценностях российского общества, для повышения способности ответственно реализовывать свои конституционные права и обязанности;

- развитие правовой и политической культуры обучающихся, расширение конструктивного участия в принятии решений, затрагивающих их права и интересы, в том числе в различных формах самоорганизации, самоуправления, общественно-значимой деятельности;

- формирование мотивов, нравственных и смысловых установок личности, позволяющих противостоять экстремизму, ксенофобии, дискриминации по социальным, религиозным, расовым, национальным признакам, межэтнической и межконфессиональной нетерпимости, другим негативным социальным явлениям.

Духовно-нравственное воспитание:

- воспитание чувства достоинства, чести и честности, совестливости, уважения к родителям, учителям, людям старшего поколения;

- формирование принципов коллективизма и солидарности, духа милосердия и сострадания, привычки заботиться о людях, находящимся в трудной жизненной ситуации;

- формирование солидарности и чувства социальной ответственности по отношению к людям с ограниченными возможностями здоровья, преодоление психологических барьеров по отношению к людям с ограниченными возможностями;

- формирование эмоционально насыщенного и духовно возвышенного отношения к миру, способности и умения передавать другим свой эстетический опыт.

Культурно-просветительское воспитание:

- формирование уважения к культурным ценностям родного города, края, страны;

- формирование эстетической картины мира;

- повышение познавательной активности обучающихся.

Научно-образовательное воспитание:

- формирование у обучающихся научного мировоззрения;

- формирование умения получать знания;

- формирование навыков анализа и синтеза информации, в том числе в профессиональной области.

Таблица с расчасовкой заочной формы обучения

Вид учебной работы	Всего ЗЕ	Всего часов	Семестр(ы)*	
ОБЩАЯ ТРУДОЕМКОСТЬ ДИСЦИПЛИНЫ	3	108		9
КОНТАКТНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩЕГОСЯ С ПРЕПОДАВАТЕЛЕМ, в том числе:		48,5		48,5
Лекции (Лек)		28		28
Практические (семинарские) занятия (Пр)		16		16
КСР		4		4
Сдача экзамена / зачета с оценкой (КПА)		0,5		0,5
САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩЕГОСЯ (СРС), в том числе:		55,5		55,5
Подготовка к промежуточной аттестации в форме: <i>Зачета с оценкой</i>		4		4
ФОРМА ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ (За – зачет, ЗО – зачет с оценкой, Э – экзамен)		30		30



КГЭ
У

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования

«КАЗАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ЭНЕРГЕТИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»
(ФГБОУ ВО «КГЭУ»)

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

Управление рисками и моделирование рискованных ситуаций

(Наименование дисциплины в соответствии с РУП)

Направление подготов-
ки

38.03.01 Экономика

(Код и наименование направления подготовки)

Направленность(и) Бизнес-аналитика и цифровая экономика

(профиль(и))

Квалификация

Бакалавр

(Бакалавр / Магистр)

г. Казань, 2021

Оценочные материалы по дисциплине «Управление рисками и моделирование рискованных ситуаций» - комплект контрольно-измерительных материалов, предназначенных для оценивания результатов обучения на соответствие дескрипторам достижения компетенций: ПК-1.3

Оценивание результатов обучения по дисциплине осуществляется в рамках текущего контроля успеваемости, проводимого по балльно-рейтинговой системе (БРС), и промежуточной аттестации.

Текущий контроль успеваемости обеспечивает оценивание процесса обучения по дисциплине.

При текущем контроле успеваемости используются следующие оценочные средства: индивидуальный опрос (устный, письменный), защиты письменных домашних заданий, проведение тестирования (письменное), контроль самостоятельной работы обучающихся (в письменной форме), др.

Промежуточная аттестация имеет целью определить уровень достижения запланированных результатов обучения по дисциплине за (4 курс, 8 семестр). Форма промежуточной аттестации *зачет с оценкой*.

Оценочные материалы включают задания для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся, разработанные в соответствии с рабочей программой дисциплины.

1. Технологическая карта

Семестр 8

Номер раздела/ темы дисциплины	Вид СРС	Наименование оценочного средства	Запланированные дескрипторы освоения дисциплине	Уровень освоения дисциплины, баллы			
				неудов-но	удов-но	хорошо	отлично
				не зачтено	зачтено		
				низкий	ниже среднего	средний	высокий
Текущий контроль успеваемости							
1. Место и роль экономических рисков в управлении деятельностью организации.	Изучение теоретического материала, подготовка к практическому занятию	<i>Тест, практическое задание</i>	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	0-3	3-5	5-8	8-12
2. Риски предприятий сферы сервиса	Изучение теоретического материала, под-	<i>Кейс задача, тест</i>	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	0-3	3-5	5-8	8-12

	готовка к практическому занятию						
3. Риск-менеджмент - система управления риском.	Изучение теоретического материала, подготовка к практическому занятию	<i>Тест, практическое задание</i>	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	0-3	3-5	5-8	8-12
4. Стратегия риск-менеджмента	Изучение теоретического материала, подготовка к практическому занятию	<i>Тест, практическое задание</i>	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	0-3	3-5	5-8	8-12
5. Методы управления финансовыми рисками.	Изучение теоретического материала, подготовка к практическому занятию	<i>Тест, практическое задание</i>	ПК-1.3 (З ₁ , У ₁ , В ₁)	0-3	3-5	5-8	8-12
Итого баллов				0-15	15-25	25-40	40-60
Промежуточная аттестация							
	Подготовка к экзамену	<i>Задания к зачету с оценкой</i>	ПК-1	менее 25	25-29	30-34	35-40
Итого баллов				менее 55	55-69	70-84	85-100

2. Перечень оценочных средств

Краткая характеристика оценочных средств, используемых при текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации обучающегося по дисциплине:

Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Оценочные материалы
Кейс-задача (КЗ)	Проблемное задание, в котором обучающемуся предлагают осмыслить реальную профессионально-ориентированную ситуацию, необходимую для решения данной проблемы	Задания для решения кейс-задачи
Практическое задание (ПЗ)	Средство оценки умения применять полученные теоретические знания в практической ситуации. Задание направлено на оценивание компетенций по дисциплине, содержит четкую инструкцию по выполнению или алгоритм действий	Комплект задач и заданий
Тест (Тест)	Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося	Комплект тестовых заданий

3. Фонд оценочных средств текущего контроля успеваемости обучающихся

Наименование оценочного средства	Кейс-задача
Представление и содержание оценочных материалов	<p>Изучите этапы постановки системы управления рисками в ОАО «Магнитогорский металлургический комбинат» и ответьте на следующие вопросы:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. что стало предпосылками внедрения службы риск-менеджмента в организационную структуру ОАО «Магнитогорский металлургический комбинат»? 2. В чем заключаются недостатки фрагментарного подхода к управлению рисками? 3. С помощью каких мероприятий в системе управления риском осуществляется регулирование кредитного риска? 4. С помощью каких мероприятий в системе управления риском осуществляется регулирование инвестиционного риска? 5. С помощью каких мероприятий в системе управления риском осуществляется регулирование риска по хозяйственным контрактам? 6. С помощью каких мероприятий в системе управления риском осуществляется регулирование курсового риска? 7. Какими основными документами регламентируется система управления рисками? Какие задачи они решают? 8. Каковы этапы формирования системы управления рисками организации? 9. Что подразумевается под «культурой риск-менеджмента»? 10. Каковы цели и содержание политики управления рисками? 11. Что такое карта рисков? Каким образом она формируется? 12. Каково содержание стандарта управления рисками? 13. Посредством каких мероприятий реализуется система управления рисками на высшем уровне руководства?

	<p>14. Посредством каких мероприятий реализуется система управления рисками на исполнительском уровне руководства?</p> <p>15. Посредством каких мероприятий реализуется система управления рисками на оперативном уровне руководства?</p> <p>16. В чем выражается принципиальное отличие системы управления рисками по направлению идентификации и методов оценки риска?</p> <p>17. В чем выражается принципиальное отличие системы управления рисками по использованию методов управления рисками?</p> <p>18. В чем выражается принципиальное отличие системы управления рисками по организационной структуре и культуре управления рисками?</p> <p>19. За счет чего достигается экономический эффект от управления отдельными видами рисков?</p>
<p>Критерии оценки и шкала оценивания в баллах</p>	<p><i>1. Знание материала</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> содержание материала раскрыто в полном объеме, предусмотренном программой дисциплины – 3 балла; <input type="checkbox"/> содержание материала раскрыто неполно, показано общее понимание вопроса, достаточное для дальнейшего изучения программного материала – 2 балл; <input type="checkbox"/> не раскрыто основное содержание учебного материала – 0 баллов; <p><i>2. Последовательность изложения</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> содержание материала раскрыто последовательно, достаточно хорошо продумано – 3 балла; <input type="checkbox"/> последовательность изложения материала недостаточно продумана – 2 балл; <input type="checkbox"/> путаница в изложении материала – 0 баллов; <p><i>3. Владение речью и терминологией</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> материал изложен грамотным языком, с точным использованием терминологии – 3,5 балла; <input type="checkbox"/> в изложении материала имелись затруднения и допущены ошибки в определении понятий и в использовании терминологии – 2 балл; <input type="checkbox"/> допущены ошибки в определении понятий – 0 баллов; <input type="checkbox"/> неумение приводить примеры при объяснении материала – 0 баллов; <input type="checkbox"/> полное неумение делать обобщение, выводы, сравнения – 0 баллов; <p>Количество баллов: максимум – 8,5 б.</p>
<p>Наименование оценочного средства</p>	<p>2. Практическое задание (Темы 1,3-5)</p>
<p>Представление и содержание оценочных материалов</p>	<p>1. Оцените риска ликвидности баланса организации по абсолютным показателям с использованием зонального метода оценки риска. Исходные данные для анализа представлены в Приложении 3. Сделайте выводы о кризисных процессах, протекаемых в организации и предложите направления по нивелированию последствий рискованных событий.</p> <p>2. Финансовый аналитик полагает, что акции компании А будут стоить \$10 за одну акцию через год. Если доходность государственных облигаций составляет 7% годовых, а ожидаемая доходность рыночного портфеля – 15%, определить, сколько следует платить за акции компании А сегодня, если коэффициент бета акций компании равен 1.5.</p> <p>3. Вы должны платить за обучение по 30 000 в конце каждого года в течение следующих 4 лет. Если процентная ставка равна 8%, сколько Вы должны отложить сегодня, чтобы покрыть всю сумму?</p>
<p>Критерии оценки и шкала оценивания</p>	<p>При оценке выполненной контрольной работы учитываются следующие критерии:</p>

<p>вания в баллах</p>	<p><i>1. Знание материала</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> содержание материала раскрыто в полном объеме, предусмотренном программой дисциплины – 3 балла; <input type="checkbox"/> содержание материала раскрыто неполно, показано общее понимание вопроса, достаточное для дальнейшего изучения программного материала – 1 балл; <input type="checkbox"/> не раскрыто основное содержание учебного материала – 0 баллов; <p><i>2. Применение конкретных примеров</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> показано умение иллюстрировать материал конкретными примерами – 3 балла; <input type="checkbox"/> приведение примеров вызывает затруднение – 1 балл; <input type="checkbox"/> неумение приводить примеры при объяснении материала – 0 баллов; <p><i>4. Уровень теоретического анализа</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> показано умение делать обобщение, выводы, сравнение – 2,5 балла; <input type="checkbox"/> обобщение, выводы, сравнение делаются с помощью преподавателя – 1 балл; <input type="checkbox"/> полное неумение делать обобщение, выводы, сравнения – 0 баллов <p>Максимальное количество баллов – 8,5 баллов</p>
<p>Наименование оценочного средства</p>	<p>3. Тест (темы 1-8)</p>
<p>Представление и содержание оценочных материалов</p>	<p><i>Выполнение тестовых заданий предусмотрено по каждой теме дисциплины. Выполняется письменно.</i></p> <p>1. Изучение внутренней информации, генерируемой самим рынком, и, в первую очередь, данных о динамике важнейших элементов рынка – это методика:</p> <ul style="list-style-type: none"> а) Фундаментального анализа; б) Технического анализа; в) Факторного анализа; г) Экспертных оценок; <p>2. Основные направления фундаментального анализа:</p> <ul style="list-style-type: none"> д) анализ и прогнозирование конъюнктуры финансового рынка в целом в увязке с общеэкономическим развитием страны; е) анализ и оценка перспектив финансового развития отдельных регионов страны; ж) анализ и оценка перспектив финансового развития отдельных отраслей экономики; з) анализ и прогнозирование динамики уровня цен на отдельные финансовые инструменты; <p>3. Агрессивный тип финансовой политики предприятия:</p> <ul style="list-style-type: none"> а) Характеризуется невысоким уровнем финансовых рисков; б) Ориентирован на достижение максимальных результатов финансовой деятельности; в) Генерирует наиболее высокие уровни финансовых рисков; г) Не учитывает дивидендную политику;
<p>Критерии оценки и шкала оценивания в баллах</p>	<p>При оценке выполненной контрольной работы учитываются следующие критерии:</p> <p><i>1. Знание материала</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <input type="checkbox"/> решение теста не вызвало затруднений, ответы верные – 4 балла; <input type="checkbox"/> решение теста вызвало затруднения, имеются негрубые ошибки – 2 балл;

□ тест не решен, имеются грубые ошибки— 0 баллов;
Максимальное количество баллов – 4 балла

4. Фонд оценочных средств промежуточной аттестации

Дается характеристика всех оценочных материалов промежуточной аттестации обучающихся в соответствии с технологической картой дисциплины

Наименование оценочного средства	Зачет с оценкой
Представление и содержание оценочных материалов	<p>Оценочные материалы, вынесенные на экзамен, состоят экзаменационных билетов с заданиями практического характера для проверки практических умений.</p> <p><i>Всего 25 экзаменационных билетов, содержащих по три задания.</i></p> <p>Примеры заданий для зачета с оценкой:</p> <p>Билет 1</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Классификация рисков и их видовая специфика. 2. Критерии потерь основных зон риска 3. Решить задачу. Финансовый аналитик полагает, что акции компании А будут стоить \$10 за одну акцию через год. Если доходность государственных облигаций составляет 7% годовых, а ожидаемая доходность рыночного портфеля – 15%, определить, сколько следует платить за акции компании А сегодня, если коэффициент бета акций компании равен 1.5. <p>Билет 2.</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Графическое представление рисков 2. Внутренний и внешний мониторинг рисков. 3. Решить задачу. Вы должны платить за обучение по 30 000 в конце каждого года в течение следующих 4 лет. Если процентная ставка равна 8%, сколько Вы должны отложить сегодня, чтобы покрыть всю сумму?
Критерии оценки и шкала оценивания в баллах	<p>Максимальное количество баллов за устный ответ – 10</p> <p>При выставлении баллов за ответы на задания в билете учитываются следующие критерии:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Владение методами и технологиями, запланированными в рабочей программе дисциплины 2. Владение специальными терминами и использование их при ответе. 3. Умение объяснять, делать выводы и обобщения, давать аргументированные ответы 4. Логичность и последовательность ответа 5. Демонстрация способности участвовать в разработке обобщенных вариантов решения проблем <p><i>От 8 до 10 баллов оценивается ответ, который показывает прочные знания основных процессов изучаемой предметной области, отличается глубиной и полнотой раскрытия темы; владение терминологическим аппаратом; умение объяснять сущность, явлений, процессов, событий, делать выводы и обобщения, давать аргументированные ответы, приводить примеры; свободное владение монологической речью,</i></p>

логичность и последовательность ответа.

От 6 до 8 баллов оценивается ответ, обнаруживающий прочные знания основных процессов изучаемой предметной области, отличается глубиной и полнотой раскрытия темы; владение терминологическим аппаратом; умение объяснять сущность, явлений, процессов, событий, делать выводы и обобщения, давать аргументированные ответы, приводить примеры; свободное владение монологической речью, логичность и последовательность ответа. Однако допускается одна – две неточности в ответе.

От 4 до 6 баллов оценивается ответ, свидетельствующий, в основном, о знании процессов изучаемой предметной области, отличающийся недостаточной глубиной и полнотой раскрытия темы; знанием основных вопросов теории; слабо сформированными навыками анализа явлений, процессов, недостаточным умением давать аргументированные ответы и приводить примеры; недостаточно свободным владением монологической речью, логичностью и последовательностью ответа. Допускается несколько ошибок в содержании ответа.

Максимальное количество баллов за выполнение практических заданий – 20

1. Правильность выполнения практического(их) задания(ий)

Максимальное количество баллов за экзамен - 40