Приложение Л.РПД Б1.В. ДВ.8.3

Филиал федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования
«Национальный исследовательский университет «МЭИ»
в г. Смоленске

УТВЕРЖДАЮ
Зам. директора
филиала ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»
в г. Смоленске
по учебно-методической работе
_____ В.В. Рожков
«___» _____ 2016 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

(НАИМЕНОВАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ)

Направление подготовки: 09.03.03 Прикладная информатика

Профиль подготовки: Прикладная информатика в управлении производством

Уровень высшего образования: бакалавриат

Нормативный срок обучения: 4 года

Учебный план, утвержденный 29.04.2016 (год начала подготовки - 2016 г.)

Смоленск – 2016 г.

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

Целью освоения дисциплины является подготовка обучающихся к информационно-аналитической профессиональной деятельности по направлению подготовки 09.03.03 Прикладная информатика (профиль подготовки: Прикладная информатика в управлении производством) посредством обеспечения этапов формирования компетенций, предусмотренных ФГОС, в части представленных ниже знаний, умений и навыков.

Задачами дисциплины является изучение понятийного аппарата дисциплины, основных теоретических положений и методов, формирование умений и привитие навыков применения теоретических знаний для решения профессиональных задач.

Дисциплина направлена на формирование следующих общекультурных и профессиональных компетенций:

ОПК-3 способностью использовать основные законы естественнонаучных дисциплин и современные информационно-коммуникационные технологии в профессиональной деятельности

В результате изучения дисциплины студент должен:

Знать:

- сущность, определение и классификацию рисков;
- взаимосвязь между рисками и результатами инвестиционной деятельности.

Уметь:

- работать со статистическим и финансовым материалом для анализа и оценки рисков;
- прогнозировать развитие рисковых и страховых ситуаций.

Владеть:

- современными программными продуктами в области прогнозирования и оценки рисков.

ПК-21 способностью проводить оценку экономических затрат и рисков при создании информационных систем

В результате изучения дисциплины студент должен:

Знать

- принципы и показатели оценки рисков;
- основы организации страхования рисков.

Уметь

- определять и оценивать уровни рисков;

Владеть

- навыками анализа новых теоретических наработок в области управления рисками при разработке информационных систем;
- приемами познания для изучения рисков и методов управления ими;
- навыками обработки исходной финансовой, статистической информации при разработке информационных систем для оценки рисков и эффективного управления ими.

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина относится к вариативной части блока Б3 «Профессиональный цикл» образовательной программы подготовки бакалавров по профилю: Прикладная информатика в управлении производством направления 09.03.03 Прикладная информатика (индекс дисциплины в соответствии с учебным планом: Б1.В.ДВ.8.3).

В соответствии с учебным планом по направлению 09.03.03 Прикладная информатика дисциплина «Управление рисками» (Б1.В.ДВ.8.3) базируется на следующих дисциплинах:

«Информатика и программирование»

«Вычислительные системы, сети и телекоммуникации»
«Базы данных»
«Информационные системы и технологии»
«Проектный практикум»
«Программная инженерия»
«Информационная безопасность»
«Статистика»
«Предметно-ориентированные экономические информационные системы»
«Маркетинг»
«Информационный менеджмент»
«Мультимедийные технологии в управлении производством»
«Информационные технологии в управлении производством»
«Экономическая информатика»
«Управление проектами»
«Интернет-технологии ведения бизнеса»
«Реинжиниринг и управление бизнес-процессами»
«Производственная логистика»
«Информационная логистика»
«Экономическая теория»
«Учет и анализ»
«Проектирование информационных систем»
«Теория экономических информационных систем»
«Производственный менеджмент»
«Информационный менеджмент»
«Экономическая информатика»
«Экономика и управление производством»
«Методы принятия управленческих решений»
«Математическая экономика»

Дисциплина базируется на знаниях, умениях и навыках, полученных в ходе прохождения практики по получению первичных профессиональных умений и навыков, в том числе первичных умений и навыков научно-исследовательской деятельности.

Знания, умения и навыки, полученные студентами в процессе изучения дисциплины, являются базой для изучения следующих дисциплин:
«Контроллинг»
«Маркетинговые коммуникации»
«Стратегический менеджмент»

Знания, умения и навыки, полученные студентами в процессе изучения дисциплины, являются базой для прохождения преддипломной практики и прохождения государственной итоговой (итоговой государственной) аттестации (выпускная квалификационная работа).

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

Аудиторная работа

Цикл:	Блок 1	Семестр
Часть цикла:	Вариативная часть	
Индекс дисциплины по учебному плану:	Б1.В.ДВ.8.3	
Часов (всего) по учебному	144	7 семестр

плану:		
Трудоемкость в зачетных единицах (ЗЕТ)	4	7семестр
Лекции (ЗЕТ, часов)	1 ЗЕТ, 36 час	7 семестр
Практические занятия (ЗЕТ, часов)	-	-
Лабораторные работы (ЗЕТ, часов)	1 ЗЕТ, 36 час	7 семестр
Курсовой проект (ЗЕТ, часов)	-	-
Объем самостоятельной работы по учебному плану (ЗЕТ, часов всего)	2 ЗЕТ, 72 час	7 семестр
Зачет с оценкой (в объеме самостоятельной работы)	0,5 ЗЕТ,18 час	7 семестр
Экзамен	-	

Самостоятельная работа студентов

Вид работ	Трудоёмкость, ЗЕТ, час
Изучение материалов лекций (лк)	0,5 ЗЕТ,18 час
Подготовка к практическим занятиям (пз)	-
Подготовка к защите лабораторной работы (лаб)	0,5 ЗЕТ, 18 час
Выполнение расчетно-графической работы	0,5 ЗЕТ, 18 час
Выполнение реферата	-
Выполнение курсового проекта	-
Самостоятельное изучение дополнительных материалов дисциплины (СРС)	-
Подготовка к тестированию	-
Подготовка к зачету	0,5 ЗЕТ, 18 час
Всего (в соответствии с УП)	**2 ЗЕТ, 72 час**
Подготовка к экзамену	-

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

№ п/п	Темы дисциплины	Всего часов на тему	Виды учебной занятий, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах) (*в соответствии с УП*)					
			лк	пр	лаб	КР	СРС	в т.ч. интеракт.
1	2	3	4	5	6	7	8	9
1	Риск как экономическая категория, его сущность.	12	4	-	-	-	8	-
2	Математические модели и методы оценки рисков.	31	8	-	8	-	15	4
3	Абсолютные показатели оценки рисков в условиях определенности.	32	8	-	8	-	16	4
4	Относительные показатели оценки рисков в условиях определенности.	32	8	-	8	-	16	4
5	Показатели оценки рисков в условиях неопределенности.	37	8	-	12	-	17	6
	всего по видам учебных занятий		**36**	**-**	**36**	**-**	**72**	**18**

Содержание по видам учебных занятий

Тема 1 Риск как экономическая категория, его сущность.

Лекция 1-2. Понятие неопределенности, классификация и факторы риска. (4 час)

Самостоятельная работа студента (СРС, 8 час)

Подготовка к лекции (2 час)

Подготовка к защите лабораторной работы (0 час)

Выполнение расчетно-графической работы (3 час)

Подготовка к зачету (3 час)

Текущий контроль:

- устный опрос: собеседование;

- письменный опрос: проверка конспектов лекций;

Тема 2. Математические модели и методы оценки рисков.

Лекция 3. Зоны предпринимательского риска. (2 час)

Лекция 4-6. Характеристика математических моделей и методов оценки риска. (6 час)

Лабораторная работа 1-2. Экономико-статистические методы учета факторов риска в управленческих решениях (4 час).

Лабораторная работа 3-4. «Экономико-статистические методы учета факторов риска и доходности в управленческих решениях**»** (4 час).

Самостоятельная работа студента (СРС, 15 час)

Подготовка к лекции (4 час)

Подготовка к защите лабораторной работы (4 час)

Выполнение расчетно-графической работы (4 час)

Подготовка к зачету (3 час)

Текущий контроль:

- устный опрос: собеседование; защита лабораторных работ.

- письменный опрос: проверка конспектов лекций; проверка отчета по лабораторной работе, проверка РГР.

Тема 3. Абсолютные показатели оценки рисков в условиях определенности.

Лекция 7-8. Характеристика абсолютных показателей риска неудовлетворительной структуры активов и пассивов организации.(4 час)

Лекция 9-10. Характеристика абсолютных показателей риска потери финансовой устойчивости и независимости организации.(4 час)

Лабораторная работа 5. «Оценка риска структуры активов по степени их ликвидности».

Лабораторная работа 6. «Оценка риска потери платежеспособности».

Лабораторная работа 7. «Оценка риска потери финансовой устойчивости».

Лабораторная работа 8. «Оценка риска банкротства».

Самостоятельная работа студента (СРС, 16 час)

Подготовка к лекции (4 час)

Подготовка к защите лабораторной работы (4 час)

Выполнение расчетно-графической работы (4 час)

Подготовка к зачету (4 час)

Текущий контроль:

- устный опрос: собеседование; защита лабораторных работ;

- письменный опрос: проверка конспектов лекций; проверка отчета по лабораторной работе; проверка РГР.

Тема 4. Относительные показатели оценки рисков в условиях определенности.

Лекция 11-12. Характеристика относительных показателей риска при использовании метода непосредственной оценки риска.(4 час)

Лекция 13-14. Характеристика относительных показателей риска при использовании метода опосредованной оценки риска. (4 час)

Лабораторная работа 9-10. «Метод анализа проектных рисков с помощью методов линейного программирования» (4 час).

Лабораторная работа 11-12. «Метод анализа риска с помощью построения дерева решений проекта» (4 час).

Самостоятельная работа студента (СРС, 16 час)

Подготовка к лекции (4час)

Подготовка к защите лабораторной работы (4 час)

Выполнение расчетно-графической работы (4 час)

Подготовка к зачету (4 час)

Текущий контроль:

- устный опрос: собеседование, защита лабораторных работ.

- письменный опрос: проверка конспектов лекций; проверка отчета по лабораторной работе; проверка РГР.

Тема 5. Показатели оценки рисков в условиях неопределенности.

Лекция 15-16. Вероятностные показатели риска. (4 час)

Лекция 17-18. Статистические показатели риска. (4 час)

Лабораторная работа 13-15. «Метод анализа рисков методом чувствительности» (6 час).

Лабораторная работа 16-18. «Метод анализа рисков методом Монте-Карло» (6 час).

Самостоятельная работа студента (СРС, 17 час)

Подготовка к лекции (4 час)

Подготовка к защите лабораторной работы (6 час)

Выполнение расчетно-графической работы (3 час)

Подготовка к зачету (4 час)

Текущий контроль:

- устный опрос: собеседование; защита лабораторных работ.

- письменный опрос: проверка конспектов лекций; проверка отчета по лабораторной работе; проверка РГР.

Промежуточная аттестация по дисциплине:

Изучение дисциплины заканчивается зачетом с оценкой. Зачет проводится в соответствии с Положением о зачетной и экзаменационной сессиях в ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ» и инструктивным письмом от 14.05.2012 г. № И-23.

Зачет по дисциплине проводится в устной форме.

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

Для обеспечения самостоятельной проекта разработаны:

Для обеспечения самостоятельной работы разработаны:

- учебно-методическое обеспечение лекционных занятий;
- методические рекомендации по выполнению лабораторных работ;
- методические рекомендации по выполнению расчетно-графической работы;
- методические рекомендации к самостоятельной работе студентов.

Учебно-методическое обеспечение аудиторной и внеаудиторной самостоятельной работы студентов, обучающихся по дисциплине «Управление рисками» представлены в методических указаниях для обучающихся по освоению дисциплины.

6. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

6.1 Перечень компетенций с указанием этапов их формирования

При освоении дисциплины формируются следующие компетенции: ОПК-3; ПК-21.

Указанные компетенции формируются в соответствии со следующими этапами:

1. Формирование и развитие теоретических знаний, предусмотренных указанными компетенциями (лекционные занятия, самостоятельная работа студентов).

2. Приобретение и развитие практических умений, предусмотренных компетенциями (лабораторные работы, РГР, самостоятельная работа студентов).

3. Закрепление теоретических знаний, умений и практических навыков, предусмотренных компетенциями, в ходе защит лабораторных работ, а также решения конкретных задач на практических занятиях, успешной сдачи экзамена.

Матрица соотнесения тем/разделов дисциплины и формируемых в них компетенций

Темы, разделы дисциплины	**Количество часов**	**Код компетенции**		
		ОПК-3	ПК-21	**Σ общее количество компетенций**
Тема 1. Риск как экономическая категория, его сущность.	12	+	+	2
Тема 2. Математические модели и методы оценки рисков	31	+	+	2
Тема 3.Абсолютные показатели оценки рисков в условиях определенности	32	+	+	2
Тема 4. Относительные показатели оценки рисков в условиях определенности	32	+	+	2
Тема 5. Показатели оценки рисков в условиях неопределенности	37	+	+	2
Итого	**144**	5	5	10

6.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описания шкал оценивания

Сформированность компетенции в рамках освоения данной дисциплины оценивается по трехуровневой шкале:

- пороговый уровень является обязательным для всех обучающихся по завершении освоения дисциплины;
- продвинутый уровень характеризуется превышением минимальных характеристик сформированности компетенции по завершении освоения дисциплины;
- эталонный уровень характеризуется максимально возможной выраженностью компетенции и является важным качественным ориентиром для самосовершенствования.

Уровень сформированности каждой компетенции на различных этапах ее формирования в процессе освоения данной дисциплины оценивается в ходе текущего контроля успеваемости и представлен различными видами оценочных средств.

Для оценки сформированности в рамках данной дисциплины компетенции ОПК-3 «способностью использовать основные законы естественнонаучных дисциплин и современные информационно-коммуникационные технологии в профессиональной деятельности», преподавателем оценивается содержательная сторона и качество материалов, представленных в конспектах лекций, отчетах студента по лабораторным работам, отчете студента по РГР. Учитываются также ответы студента на вопросы по соответствующим видам занятий при текущем контроле – собеседование, защита лабораторных работ.

Принимается во внимание наличие:

Наличие **знаний:**

- о сущности, определения и классификации рисков; о взаимосвязи между рисками и результатами управленческой деятельности.

Наличие **умений**:

- работать со статистическим и финансовым материалом для анализа и оценки рисков; прогнозировать развитие рисковых и страховых ситуаций.

Присутствие **навыков**:

- пользования современными программными продуктами в области прогнозирования и оценки рисков.

Таблица - Показатели и критерии оценивания уровня сформированности компетенции ОПК-3 способностью использовать основные законы естественнонаучных дисциплин и современные информационно-коммуникационные технологии в профессиональной деятельности

Результаты освоения (Показатели)	Уровни сформирован-ности	Критерии оценивания	Оценка (шкала оценивания)	Оцениваемая форма контроля
Знать - сущность, определение и классификацию рисков; - взаимосвязь между финансовыми рисками и результатами деятельности организации. **Уметь** - работать со статистическим и финансовым материалом для анализа и оценки рисков; - прогнозировать развитие рисковых и страховых ситуаций. **Владеть** - современными программными продуктами в области прогнозирования и оценки рисков	Эталонный.	Хорошо знать сущность, рисков для разработки с использованием современных информационно-коммуникационных технологий политики управления рисками организации.	5	Конспект лекций студента. Собеседование. Отчет и защита лабораторной работы. Отчет по РГР. Зачет с оценкой.
	Продвинутый	Классифицировать риски организации. Знать современные информационно-коммуникационные технологии прогнозирования рисков.	4	
	Пороговый	Знать современные информационно-коммуникационные технологии прогнозирования рисков.	3	
	Ниже порогового	Не обладает необходимыми знаниями, умениями и навыками по компетенции.	2	

Для оценки сформированности в рамках данной дисциплины компетенции ПК-21 «способностью проводить оценку экономических затрат и рисков при создании информационных систем» преподавателем оценивается содержательная сторона и качество материалов, представленных в конспектах лекций, отчетах студента по лабораторным работам, отчете студента по РГР. Учитываются также ответы студента на вопросы по соответствующим видам занятий при текущем контроле – собеседование, защита лабораторных работ.

Принимается во внимание наличие:

Наличие **знаний:**

- о принципах и показателях оценки рисков;
- об основах организации страхования рисков.

Наличие **умений**:

- определять и оценивать уровни рисков; работать со статистическим и финансовым материалом для анализа и оценки рисков; прогнозировать развитие финансовых и страховых ситуаций при разработке информационных систем.

Присутствие **навыков**:

- анализа новых теоретических наработок в области управления рисками и их страхования; приемами познания для изучения рисков и методов управления ими;

обработки исходной финансовой, статистической информации для оценки рисков и эффективного управления ими.

Таблица - Показатели и критерии оценивания уровня сформированности компетенции ПК-21 способностью проводить оценку экономических затрат и рисков при создании информационных систем

Результаты освоения (Показатели)	Уровни сформирован-ности	Критерии оценивания	Оценка (шкала оценивания)	Оцениваемая форма контроля
Знать - принципы и показатели оценки рисков; - основы организации страхования рисков. **Уметь** - определять и оценивать уровни рисков; **Владеть** - навыками анализа новых теоретических наработок в области управления рисками при разработке информационных систем; - приемами познания для изучения рисков и методов управления ими; - навыками обработки исходной финансовой, статистической информации при разработке информационных систем для оценки рисков и эффективного управления ими.	Эталонный.	Хорошо знать сущность, концепции и инструментарий управления рисками для разработки политики управления рисками при разработке информационных систем.	5	Конспект лекций студента. Собеседование. Отчет и защита лабораторной работы. Отчет по РГР. Зачет с оценкой.
	Продвинутый	Знать понятие рисков и методы их оценки. Использовать методы оценки рисков при разработке информационных систем..	4	
	Пороговый	Классифицировать риски и перечислить методы их оценки и анализа.	3	
	Ниже порогового	Не обладает необходимыми знаниями, умениями и навыками по компетенции.	2	

Критерии оценки результатов сформированности компетенций при использовании различных форм контроля.

Критерии оценивания конспекта лекций:

Оценки «отлично» заслуживает студент, который привел развёрнутые ответы на все вопросы конспектирования с приведением фактов и примеров.

Оценки «хорошо» заслуживает студент, который привел развёрнутые ответы на все вопросы конспектирования с незначительным числом фактов и примеров.

Оценки «удовлетворительно» заслуживает студент, который привел ответы на все вопросы конспектирования.

Оценки «неудовлетворительно» заслуживает студент, который не предоставил конспект.

Критерии оценивания собеседования:

Оценки «отлично» заслуживает студент, который полно и развернуто ответил на вопрос.

Оценки «хорошо» заслуживает студент, который полно ответил на вопрос.

Оценки «удовлетворительно» заслуживает студент, который не полно ответил на вопрос.

Оценки «неудовлетворительно» заслуживает студент, не ответил на вопрос.

Критерии оценивания результатов уровня сформированности компетенций по выполнению лабораторных работ:

Оценки «отлично» заслуживает студент, который выполнил все задания, обосновал выполнение элементов заданий (привел цифровые данные, правильно провел расчеты, привел

факты и пр.), оформил работу с учетом ГОСТ и требований кафедры, убедительно, полно и развернуто отвечает на вопросы при защите.

Оценки «хорошо» заслуживает студент, который выполнил все задания, обосновал выполнение элементов заданий (привел цифровые данные, правильно провел расчеты, привел факты и пр.), оформил работу с учетом ГОСТ и требований кафедры, практически отвечает на вопросы во время защиты.

Оценки «удовлетворительно» заслуживает студент, который выполнил все задания, обосновал выполнение элементов заданий (привел цифровые данные, правильно провел расчеты, привел факты и пр.), оформил работу с незначительными отклонениями в требованиях ГОСТ и кафедры, ошибается в ответах на вопросы во время защиты, но исправляет ошибки при ответе на наводящие вопросы.

Оценки «неудовлетворительно» заслуживает студент, который выполнил не все задания, не обосновал выполнение элементов заданий (не привел цифровые данные, неправильно провел расчеты, не привел факты и пр.), оформил работу с грубыми нарушениями ГОСТ и требований кафедры, практически не отвечает на вопросы во время защиты.

Критерии оценивания расчетно-графической работы:

Оценки «отлично» заслуживает студент, который привел полные, точные и развёрнутые материалы по работам/заданиям, оформил отчет по РГР с учетом ГОСТ и требований кафедры.

Оценки «хорошо» заслуживает студент, который привел полные, не совсем точные и развёрнутые материалы по работам/заданиям, оформил отчет по РГР с учетом ГОСТ и требований кафедры, однако не выдержал объем отчета по РГР.

Оценки «удовлетворительно» заслуживает студент, который привел не полные, не совсем точные материалы по работам/заданиям, оформил работу с незначительными отклонениями в требованиях ГОСТ и кафедры.

Оценки «неудовлетворительно» заслуживает студент, который привел не полные, не совсем точные материалы по работам/заданиям, сделал существенные ошибки в расчетах и выводах, оформил работу с грубыми нарушениями ГОСТ и требований кафедры.

Сформированность уровня компетенции не ниже порогового является основанием для допуска студента к промежуточной аттестации по данной дисциплине.

Формой промежуточной аттестации по данной дисциплине является зачет с оценкой, оцениваемый по принятой в ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ» четырехбалльной системе: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

Зачет с оценкой проводится в устной форме (собеседование).

Оценки «отлично» заслуживает студент, обнаруживший всестороннее, систематическое и глубокое знание материалов изученной дисциплины, умение свободно выполнять задания, предусмотренные программой, усвоивший основную и знакомый с дополнительной литературой, рекомендованной рабочей программой дисциплины; проявивший творческие способности в понимании, изложении и использовании материалов изученной дисциплины, безупречно ответившему не только на вопросы, но и на дополнительные вопросы в рамках рабочей программы дисциплины, правильно выполнившему практические задания.

Оценки «хорошо» заслуживает студент, обнаруживший полное знание материала изученной дисциплины, успешно выполняющий предусмотренные задания, усвоивший основную литературу, рекомендованную рабочей программой дисциплины; показавшему систематический характер знаний по дисциплине, ответившему на все вопросы, правильно выполнившему практические задания, но допустившему при этом непринципиальные ошибки.

Оценки «удовлетворительно» заслуживает студент, обнаруживший знание материала изученной дисциплины в объеме, необходимом для дальнейшей учебы и предстоящей профессиональной деятельности, справляющийся с выполнением заданий, знакомый с основной литературой, рекомендованной рабочей программой дисциплины; допустивший

погрешность в ответе на теоретические вопросы и/или при выполнении практических заданий, но обладающий необходимыми знаниями для их устранения под руководством преподавателя, либо неправильно выполнившему практическое задание, но по указанию преподавателя выполнивший другие практические задания из того же раздела дисциплины.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, обнаружившему серьезные пробелы в знаниях основного материала изученной дисциплины, допустившему принципиальные ошибки в выполнении заданий, не ответившему на все вопросы и неправильно выполнившему практическое задание (неправильное выполнение только практического задания не является однозначной причиной для выставления оценки «неудовлетворительно»). Как правило, оценка «неудовлетворительно ставится студентам, которые не могут продолжить обучение по образовательной программе без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине (формирования и развития компетенций, закрепленных за данной дисциплиной). Оценка «неудовлетворительно» выставляется также, если студент отказался сдавать зачет или нарушил правила сдачи зачета (списывал, подсказывал, обманом пытался получить более высокую оценку и т.д.).

Оценка по зачету выводится с учетом совокупного результата освоения всех компетенций по данной дисциплине (в соответствии с инструктивным письмом НИУ МЭИ от 14 мая 2012 года № И-23). Оценка зачета по дисциплине определяется как среднее арифметическое значение оценок по всем видам текущего контроля и оценки итогового собеседования.

В зачетную книжку студента и выписку к диплому выносится оценка *зачета* по дисциплине за 7 семестр.

6.3 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

Оценка знаний, умений и навыков в процессе изучения дисциплины производится с использованием фонда оценочных средств.

Вопросы по формированию и развитию теоретических знаний, предусмотренных компетенциями, закрепленными за дисциплиной (примерные вопросы по лекционному материалу дисциплины):

1. Охарактеризуйте взаимосвязь понятий неопределенности и риска.
2. Назовите основные причины, порождающие неопределенность.
3. Каковы основные черты риска?
4. Чем вызвано многообразие видов рисков?
5. В чем отличие внешних и внутренних факторов риска? Раскройте их содержание.
6. Что понимается под управлением рисками?
7. Охарактеризуйте укрупненную схему управления предприятием на уровне «черного ящика».
8. Назовите основные элементы системы управления предприятием.
9. Обоснуйте необходимость управления рисками предприятия.
10. Назовите основные этапы алгоритма управления рисками.
11. Охарактеризуйте основные зоны предпринимательского риска.
12. Назовите основные задачи, решаемые в теории риска, и методы их решения.
13. По каким категориям определенности проводится классификация показателей риска?
14. Какие показатели входят в состав абсолютных показателей риска?
15. Проведите классификацию активов по степени риска их ликвидности с учетом шкалы оценки риска.

16. Назовите основные этапы алгоритма оценки риска структуры активов по степени их ликвидности.
17. Проведите классификацию состояния ликвидности баланса предприятия с учетом шкалы оценки риска потери платежеспособности.
18. Назовите основные этапы алгоритма оценки риска потери платежеспособности.
19. Раскройте содержание трехкомпонентного вектора, характеризующего финансовую устойчивость предприятия.
20. Проведите классификацию финансовой устойчивости предприятия с учетом шкалы оценки риска потери финансовой устойчивости.
21. Назовите основные этапы алгоритма оценки риска потери финансовой устойчивости по абсолютным показателям.
22. Перечислите основные относительные показатели оценки риска.
23. Назовите основные финансовые коэффициенты ликвидности (платежеспособности).
24. Охарактеризуйте относительные показатели оценки риска потери финансовой устойчивости и независимости.
25. Раскройте содержание показателей предпринимательского риска в условиях частичной неопределенности.
26. В каких случаях используется интервальная оценка риска?
27. Какую информацию содержат платежная матрица и матрица рисков? В чем их отличие?
28. Как построить матрицу рисков по известной платежной матрице?
29. Какие стратегии включаются в матрицу решений?
30. Назовите критерии выбора решений в условиях частичной неопределенности.
31. Раскройте сущность критерия рациональности Лапласа.
32. Назовите критерии выбора решений в условиях полной неопределенности.

Вопросы по приобретению и развитию практических умений, предусмотренных компетенциями, закрепленными за дисциплиной
(примеры вопросов к лабораторным работам)

1. Что такое риск?
2. Как различаются понятия «риск» и «неопределенность»?
3. В чем специфика информационного и оценочного подхода к такому разделению»риск» и «неопределенность»?
4. В чем состоит объективное понимание риска?
5. В чем состоит субъективное понимание риска?
6. Перечислите основные причины популярности субъективного понимания риска.
7. Почему объективное понимание риска может быть более адекватным?
8. Назовите структурные характеристики риска и поясните их смысл.
9. Дайте определение экономического риска.
10. Приведите примеры экономических рисков.
11. Связано ли понятие экономических рисков исключительно с теми рисками, возникновение которых приводит к денежному ущербу?
12. В чем состоит содержание идентификации и анализа рисков?
13. Какие методы сбора и анализа информации используются при идентификации и анализе риска?
14. Какие этапы можно выделить в процессе идентификации и анализа рисков?
15. Перечислите и кратко охарактеризуйте основные принципы информационного обеспечения системы управления риском.
16. Дайте общую характеристику внутренних источников информации, необходимой для управления риском.
17. Почему необходимо использовать внешние источники данных?

18. Охарактеризуйте внешние источники информации, необходимой для управления риском.
19. Перечислите и кратко охарактеризуйте источники информации для идентификации риска.
20. Укажите причины, по которым необходимо использовать информационные технологии в процессе управления риском.
21. Дайте краткую характеристику подсистемы сбора и обработки информации по управлению рисками.
22. Перечислите достоинства и недостатки использования подсистемы сбора и обработки информации по управлению рисками.
23. Что такое визуализация рисков?
24. Что такое приемлемый риск?
25. Какие факторы влияют на установление уровня приемлемого риска?
26. На основе каких принципов определяются пороговые значения критериальных показателей, которые используются для измерения риска?
27. Что такое мера риска?
28. Что такое рисковый капитал?

Расчетно-графическая работа (РГР) по материалам производственной практики должена содержать аналитические и графические расчеты по трем заданиям. Тема РГР: «Оценка риска банкротства организации».

Описание лабораторных работ представлено в методических указаниях для обучающихся по освоению дисциплины.

Методические указания к РГР представлены в методических указаниях для обучающихся по освоению дисциплины.

Вопросы по закреплению теоретических знаний, умений и практических навыков, предусмотренных компетенциями (вопросы к зачету)

1. Взаимосвязь понятий неопределенности и риска.
2. Основные причины, порождающие неопределенность.
3. Основные черты риска. Отличие внешних и внутренних факторов риска.
4. Управлением рисками. Укрупненная схема управления организацией на уровне «черного ящика».
5. Основные элементы системы управления организацией.
6. Необходимость управления рисками организации.
7. Основные этапы алгоритма управления рисками.
8. Основные зоны предпринимательского риска.
9. Основные задачи, решаемые в теории риска, и методы их решения.
10. Классификация показателей риска?
11. Показатели входящие в состав абсолютных показателей риска?
12. Классификацию активов по степени риска их ликвидности с учетом шкалы оценки риска.
13. Основные этапы алгоритма оценки риска структуры активов по степени их ликвидности.
14. Основные этапы алгоритма оценки риска потери платежеспособности.
15. Раскройте содержание трехкомпонентного вектора, характеризующего финансовую устойчивость предприятия.
16. Классификация финансовой устойчивости организации с учетом шкалы оценки риска потери финансовой устойчивости.
17. Основные этапы алгоритма оценки риска потери финансовой устойчивости по абсолютным показателям.

18. Основные относительные показатели оценки риска.
19. Основные финансовые коэффициенты ликвидности (платежеспособности).
20. Относительные показатели оценки риска потери финансовой устойчивости и независимости.
21. Содержание показателей предпринимательского риска в условиях частичной неопределенности.
22. Интервальная оценка риска. В каких случаях она используется.

6.4 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций

Процедуры оценивания знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций, изложены в п.6.1 и 6.2 настоящей программы и в методических указания для обучающихся по освоению дисциплины.

7. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

а) основная литература:

1 Алексеенко В. Б. Кутлыева Г. М. Мочалова Ю. И. Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия: [электронный ресурс] : учебно-методическое пособие. – М. : Российский университет дружбы народов, 2013. – 88с. – Режим доступа: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_view&book_id=226864
2 Воробьев С.Н. Балдин К.В. Управление рисками в предпринимательстве, 4 издание: [электронный ресурс] : учебно-методическое пособие. – М. : Издательство «Дашков и К», 2013. – 157с. – Режим доступа: http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=50264

б) дополнительная литература:

1 Управление рисками проектов: [электронный ресурс] : учебное пособие. / Под ред. Гребенкина А.В. – Екатеринбург : Издательство Уральского университета, 2014. – 186с. – Режим доступа: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_view&book_id=276487
2 Репнев В. А. Кризисный менеджмент: [электронный ресурс] : теория и практика. – М. : Директ-Медиа, 2014. – 508с. – Режим доступа: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_view&book_id=210616
3 Аксенов Ю.С. Инвестиционный менеджмент предприятий: [электронный ресурс] : учебное пособие. – М. : Лаборатория Книги. – 2010. – 56с. – Режим доступа: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_view&book_id=87804

8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» необходимых для освоения дисциплины

1 Справочная правовая система Консультант плюс [электронный ресурс] - Режим доступа : http://www.consultant.ru/online/
2 Бизнес журнал [электронный ресурс] - Режим доступа : http://www.business-magazine.ru/
3 Энциклопедия Экономиста [электронный ресурс] - Режим доступа : http://www.grandars.ru/

9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Дисциплина предусматривает лекции каждую неделю и лабораторные работы раз в две недели по 4 часа, а также выполнение расчетно-графической работы. Изучение курса завершается *зачетом с оценкой*.

Успешное изучение курса требует посещения лекций, активной работы на лабораторных работах, выполнения всех учебных заданий преподавателя, ознакомления с основной и дополнительной литературой.

Во время **лекции** студент должен вести краткий конспект.

Работа с конспектом лекций предполагает просмотр конспекта в тот же день после занятий. При этом необходимо пометить материалы конспекта, которые вызывают затруднения для понимания. При этом обучающийся должен стараться найти ответы на затруднительные вопросы, используя рекомендуемую литературу. Если ему самостоятельно не удалось разобраться в материале, необходимо сформулировать вопросы и обратится за помощью к преподавателю на консультации или ближайшей лекции.

Обучающемуся необходимо регулярно отводить время для повторения пройденного материала, проверяя свои знания, умения и навыки по контрольным вопросам.

Лабораторные работы составляют важную часть профессиональной подготовки студентов. Они направлены на экспериментальное подтверждение теоретических положений и формирование учебных и профессиональных практических умений.

Выполнение студентами лабораторных работ направлено на:

- обобщение, систематизацию, углубление, закрепление полученных теоретических знаний по конкретным темам дисциплин;
- формирование необходимых профессиональных умений и навыков;

Дисциплины, по которым планируются лабораторные проекта и их объемы, определяются рабочими учебными планами.

Методические указания по проведению лабораторных работ разрабатываются на срок действия рабочей программы дисциплины и включают:

- заглавие, в котором указывается вид проекта (лабораторная), ее порядковый номер, объем в часах и наименование;
- цель проекта;
- предмет и содержание проекта;
- оборудование, технические средства, инструмент;
- порядок (последовательность) выполнения проекта;
- правила техники безопасности и охраны труда по данной работе (по необходимости);
- общие правила к оформлению проекта;
- контрольные вопросы и задания;
- список литературы (по необходимости).

Содержание лабораторных работ фиксируется в разделе 4 настоящей рабочей программы.

При планировании лабораторных работ следует учитывать, что наряду с основной целью - подтверждением теоретических положений - в ходе выполнения заданий у студентов формируются практические умения и навыки обращения с лабораторным оборудованием, аппаратурой и пр., которые могут составлять часть профессиональной практической подготовки, а также исследовательские умения (наблюдать, сравнивать, анализировать, устанавливать зависимости, делать выводы и обобщения, самостоятельно вести исследование, оформлять результаты).

Состав заданий для лабораторной проекта должен быть спланирован с таким расчетом, чтобы за отведенное время они могли быть качественно выполнены большинством студентов.

Необходимыми структурными элементами лабораторной работы, помимо самостоятельной деятельности студентов, являются инструктаж, проводимый преподавателем, а также организация обсуждения итогов выполнения лабораторной проекта.

Выполнению лабораторных работ предшествует проверка знаний студентов – их теоретической готовности к выполнению задания.

При подготовке к **лабораторным работам** необходимо просмотреть конспекты лекций и методические указания, рекомендованную литературу по данной теме; подготовиться к ответу на контрольные вопросы.

В ходе выполнения индивидуального задания лабораторной работы студент готовит отчет о работе (в программе Microsoft Office или любом другом текстовом редакторе). В отчет заносятся результаты выполнения каждого пункта задания (схемы, диаграммы (графики),

таблицы, расчеты, ответы на вопросы пунктов задания, выводы и т.п.). Примерный образец оформления отчета имеется у преподавателя (*либо прилагается к настоящей программе*).

За 10 мин до окончания лабораторной работы преподаватель проверяет объём выполненной работы и отмечает результат в рабочем журнале.

Оставшиеся невыполненными пункты задания практического занятия студент обязан доделать самостоятельно.

Помимо собственно выполнения работы для каждой лабораторной работы предусмотрена процедура защиты, в ходе которой преподаватель проводит устный или письменный опрос студентов для контроля понимания выполненных ими измерений, правильной интерпретации полученных результатов и усвоения ими основных теоретических и практических знаний по теме лабораторной работы.

РГР – самостоятельная учебная работа студентов, выполняемая в течение 7 семестра под руководством преподавателя. Включает комплекс исследовательских и расчетных работ по установленной тематике.

Тема РГР: « Абсолютные показатели оценки риска банкротства».

РГР проект выполняется с целью ознакомления студентов с общими принципами и методами оценки абсолютных и относительных показателей риска, закрепления полученных знаний и приобретения навыков самостоятельного решения практических задач по дисциплине «Управление риском». С помощью РГР студенты овладевают методами оценки и анализа рисков деятельности организации.

РГР состоит из следующих этапов:

1. Расчет риска неудовлетворительной структуры активов и пассивов.
2. Расчет риска потери платежеспособности.
3. Расчет риска потери финансовой устойчивости и независимости.

В выводах по РГР на основании произведенных расчетов должен быть определен риск банкротства организации.

Работа проводится на основе материалов, собранных в ходе прохождения производственной практики, методических указаний и литературных источников по управлению рисками и других смежных дисциплин. Задание на РГР формируется индивидуально для каждого студента консультирующим преподавателем на основе собранного практического исходного материала.

При подготовке к **зачету** в дополнение к изучению конспектов лекций, учебных пособий и слайдов, необходимо пользоваться учебной литературой, рекомендованной настоящей программой. При подготовке к зачету нужно изучить теорию: определения всех понятий и подходы к оцениванию до состояния понимания материала.

Самостоятельная работа студентов (СРС) по дисциплине играет важную роль в ходе всего учебного процесса. Методические материалы и рекомендации для обеспечения СРС готовятся преподавателем и выдаются студенту.

Методические материалы и рекомендации для обеспечения самостоятельной работы студентов представлены в методических указаниях для обучающихся по освоению дисциплины.

10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

При проведении **лекционных** занятий предусматривается использование систем мультимедиа.

При проведении **лабораторных работ** предусматривается использование программного обеспечения Microsoft Office (электронные таблицы Microsoft Excel и текстовый редактор Microsoft Word).

При выполнении **РГР** предусматривается использование программного обеспечения Microsoft Office (электронные таблицы Microsoft Excel и текстовый редактор Microsoft Word).

11. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Лекционные занятия проводятся в аудитории, оснащенной презентационной мультимедийной техникой (проектор, экран, компьютер/ноутбук).

Лабораторные работы по данной дисциплине проводятся в компьютерном классе **А-317, А-304** оборудованном современными лицензионными программно-техническими средствами, с доступом к сети Интернет, оборудованном столами для конференции, досками передвижными (мел-маркер-экран), многофункциональными устройствами.

Авторы

ст. преп. Л.А. Березникова

Зав. кафедрой МИТЭ

д-р техн. наук, профессор М.И. Дли

Программа одобрена на заседании кафедры Менеджмента и информационных технологий в экономике от 28 августа 2015 года, протокол № 1.

ЛИСТ РЕГИСТРАЦИИ ИЗМЕНЕНИЙ									
Номер изменения	Номера страниц				Всего страниц в документе	Наименование и № документа, вводящего изменения	Подпись, Ф.И.О. внесшего изменения в данный экземпляр	Дата внесения изменения в данный экземпляр	Дата введения изменения
	изменных	заменных	новых	аннулированных					
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10