

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
"Дальневосточный государственный университет путей сообщения"
(ДВГУПС)

УТВЕРЖДАЮ

Зав.кафедрой

(к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Немчанинова М.А.,
канд. экон. наук,



27.05.2025

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины Управление рисками

для направления подготовки 01.04.02 Прикладная математика и информатика

Составитель(и): к.э.н., доцент, Царионова Ю.В.

Обсуждена на заседании кафедры: (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от 13.05.2025г. № 9

Обсуждена на заседании методической комиссии по родственным направлениям и специальностям: Протокол

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК РНС

__ ____ 2026 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2026-2027 учебном году на заседании кафедры (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от __ ____ 2026 г. № __
Зав. кафедрой Немчанинова М.А., канд. экон. наук, доцент

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК РНС

__ ____ 2027 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2027-2028 учебном году на заседании кафедры (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от __ ____ 2027 г. № __
Зав. кафедрой Немчанинова М.А., канд. экон. наук, доцент

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК РНС

__ ____ 2028 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2028-2029 учебном году на заседании кафедры (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от __ ____ 2028 г. № __
Зав. кафедрой Немчанинова М.А., канд. экон. наук, доцент

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель МК РНС

__ ____ 2029 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2029-2030 учебном году на заседании кафедры (к307) Финансы и бухгалтерский учёт

Протокол от __ ____ 2029 г. № __
Зав. кафедрой Немчанинова М.А., канд. экон. наук, доцент

Рабочая программа дисциплины Управление рисками

разработана в соответствии с ФГОС, утвержденным приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 10.01.2018 № 13

Квалификация **магистр**

Форма обучения **очная**

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

Общая трудоемкость **4 ЗЕТ**

Часов по учебному плану	144	Виды контроля в семестрах:
в том числе:		зачёты (семестр) 3
контактная работа	38	РГР 3 сем. (1)
самостоятельная работа	106	

Распределение часов дисциплины по семестрам (курсам)

Семестр (<Курс>.<Семес тр на курсе>)	3 (2.1)		Итого	
Неделя	12 4/6			
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	16	16	16	16
Практически е	16	16	16	16
Контроль самостоятель ной работы	6	6	6	6
В том числе инт.	18	18	18	18
Итого ауд.	32	32	32	32
Контактная работа	38	38	38	38
Сам. работа	106	106	106	106
Итого	144	144	144	144

1. АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

1.1	Место и роль рисков в экономических отношениях: понятие риска, классификация рисков, система неопределенностей, процесс управления и методы оценки экономических рисков. Количественное описание экономического риска в условиях неопределенности. Оценка предпринимательских рисков: измерители предпринимательских рисков, статистические методы принятия решений. Классификация рисков по степени последствий. Стратегии управления риском. Диверсификация и хеджирование. Страхование как инструмент управления риском.
-----	---

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Код дисциплины:	Б1.О.05
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:
2.1.1	Математические методы и модели статистических задач
2.1.2	Дискретные и непрерывные математические модели
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:
2.2.1	Разработка и реализация проектов
2.2.2	Технологическая (проектно-технологическая) практика

3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

УК-4: Способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия	
Знать:	
Правила и закономерности личной и деловой устной и письменной коммуникации; современные коммуникативные технологии на русском и иностранном языках; существующие профессиональные сообщества для про-фессионального взаимодействия.	
Уметь:	
Применять на практике коммуникативные технологии, методы и способы делового общения для академического и профессионального взаимодействия.	
Владеть:	
Методикой межличностного делового общения на русском и иностранном языках, с применением профессиональных языковых форм, средств и современных коммуникативных технологий.	
ОПК-3: Способен разрабатывать математические модели и проводить их анализ при решении задач в области профессиональной деятельности	
Знать:	
Методы разработки математических моделей и методы анализа для решения задач в области профессиональной деятельности.	
Уметь:	
Разрабатывать математические модели и проводить их анализ при решении задач в области профессиональной деятельности.	
Владеть:	
Методами разработки математических моделей и навыками проводить их анализ при решении задач в области профессиональной деятельности.	
ПК-1: Способен к углубленному анализу проблем, постановки и обоснования задач научной и проектной деятельности	
Знать:	
Принципы построения составных сетей; технологии передачи данных в локальных и глобальных сетях; доменную систему имен; использование CMS-систем для организации Web-ресурсов; программирование с использованием языков JavaScript, VBScript, Perl; протоколы и серверы сети интернет; принципы создания Web-ресурсов с использованием таблиц каскадных стилей CSS; постановку математической задачи; методы самостоятельного приобретения и использования научной информации в проектной деятельности и в новых областях; современные информационные технологии и методы их использования для самостоятельного приобретения новых знаний и умений, в том числе в новых областях знаний.	
Уметь:	
Осуществлять информационный поиск в сети Интернет; создавать Web-ресурсы с использованием языков разметки HTML; XML, а так же с использованием языков программирования VBScript; JavaScript; применять программы фильтрации трафика (Firewall); выбрать нужный метод решения задачи; решать типовые задачи и сводить чуть более сложные задания к типовым по известным алгоритмам; самостоятельно приобретать с помощью информационных технологий и использовать в проектной деятельности новые знания и умения, в том числе в новых областях знаний; объяснять взаимосвязь физических явлений и математических формулировок; сделать обзор возможных алгоритмов решения, выбрать и	

обосновать оптимальный.

Владеть:

Созданием динамических сценариев работы Web-ресурсов; организацией взаимодействия клиентского и серверного программного обеспечения; осуществлением удаленного доступа по Telnet протоколу работы в сети INTERNET с использованием современных технологий; построением математической модели для поставленной задачи; различными методами анализа построения модели; навыки использования аналитических и приближенных методов решения; навыками разработки схемы решения задач в научной и проектной деятельности; навыками оценки точности построенного решения; приемами приобретения новых научных и профессиональных знаний с использованием современных процессов обработки и накопления информации в научной и проектной деятельности.

4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ), СТРУКТУРИРОВАННОЕ ПО ТЕМАМ (РАЗДЕЛАМ) С УКАЗАНИЕМ ОТВЕДЕННОГО НА НИХ КОЛИЧЕСТВА АКАДЕМИЧЕСКИХ ЧАСОВ И ВИДОВ УЧЕБНЫХ ЗАНЯТИЙ

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Примечание
	Раздел 1. Лекции						
1.1	Место и роль рисков в экономических отношениях. Понятие риска, классификация рисков, система неопределенности /Лек/	3	2	ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1	0	
1.2	Процесс управления рисками и методы оценки экономических рисков /Лек/	3	2	ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	
1.3	Количественное описание экономического риска в условиях неопределенности. Оценка предпринимательских рисков: измерители предпринимательских рисков, статистические методы принятия решений. /Лек/	3	2	ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	
1.4	Стратегии управления риском. Методы принятия управленческих решений в условиях неопределенности. Анализ чувствительности проектов. Метод Монте-Карло /Лек/	3	2	ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	2	Проблемная лекция
1.5	Методы принятия управленческих решений в условиях неопределенности . Дерево решений. Метод сценариев /Лек/	3	2	ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	2	Проблемная лекция
1.6	Опреативное управление риском на основе досрочного прекращения проекта и увеличения расходов на рекламу /Лек/	3	2	ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	

1.7	Диверсификация и хеджирование. Страхование как инструмент управления риском /Лек/	3	2	ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	
1.8	Управление рисками долгосрочных инвестиционных проектов. с помощью реальных опционв. Использование эквивалентных портфелей для оценки рисковых инвестиций /Лек/	3	2	ПК-1 УК-4	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6 Л1.7 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	
	Раздел 2. Практики						
2.1	Место и роль рисков в экономических отношениях. Понятие риска, классификация рисков, система неопределенности /Пр/	3	2	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	2	Работа в малых группах
2.2	Стратегии управления риском /Пр/	3	2	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	2	Работа в малых группах
2.3	Количественное описание рисков. Измерение рисков и критерии принятия рисковых решений /Пр/	3	2	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	2	Работа в малых группах
2.4	Методы принятия управленческих решений в условиях неопределенности. Анализ чувствительности проектов. Метод Монте-Карло /Пр/	3	2	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	2	Работа в малых группах
2.5	Методы принятия управленческих решений в условиях неопределенности . Дерево решений. Метод сценариев /Пр/	3	2	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	
2.6	Опреативное управление риском на основе досрочного прекращения проекта и увеличения расходов на рекламу /Пр/	3	2	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	2	Работа в малых группах
2.7	Упрвление риском на основе диверсификации /Пр/	3	2	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	2	Работа в малых группах

2.8	Управление рисками долгосрочных инвестиционных проектов. с помощью реальных опционв. Использование эквивалентных портфелей для оценки рисковых инвестиций /Пр/	3	2	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	2	Работа в малых группах
Раздел 3. Самостоятельная работа							
3.1	Подготовка к практическим занятиям /Ср/	3	20	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	
3.2	Подготовка РГР /Ср/	3	30	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	
3.3	Подготовка к зачету /Ср/	3	30	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	
3.4	Изучение литературы /Ср/	3	26	ОПК-3 ПК-1 УК-4	Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.8 Л1.9Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Э1	0	

5. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Размещены в приложении

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Перечень основной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Крышкин О.	Настольная книга по внутреннему аудиту: риски и бизнес-процессы	Москва: Альпина Паблишер, 2016, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=279758
Л1.2	Овчаров А. О.	Туристический комплекс России: тенденции, риски, перспективы Монография	Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2009, http://znanium.com/go.php?id=155401
Л1.3	Безденежных В.М. , Дадалко В.А. , Синявский Н.Г.	Проектирование систем управления рисками организации: Учебник	Москва: КноРус, 2019, https://www.book.ru/book/930212
Л1.4	Савенкова Е. В.	Анализ и оценка рисков: методические указания к практическому занятию по дисциплине «Управление рисками в образовании»: методическое пособие	Москва: Московский педагогический государственный университет, 2018, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=500526

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.5	Суворова А. П., Репина О. М.	Риск-менеджмент: учебное пособие	Йошкар-Ола: ПГТУ, 2018, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=560489
Л1.6	Ласкина Л. Ю., Силакова Л. В.	Оценка и управление рисками в инновационной деятельности: учебное пособие	Санкт-Петербург: Университет ИТМО, 2019, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=566785
Л1.7	Деревяшкин С. А.	Оценка рисков: курс лекций (лекция)	Йошкар-Ола: ПГТУ, 2019, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=570617
Л1.8	Васин С.М., Шутов В.С.	Управление рисками на предприятии: Учебное пособие	Москва: КноРус, 2021, http://www.book.ru/book/936231
Л1.9	Антонов Г. Д., Иванова О.П.	Управление рисками организации: Учебник	Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2020, http://znanium.com/catalog/document/?pid=1052461&id=346774

6.1.2. Перечень дополнительной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Ерошенко П. Д.	Риски и неопределенность в менеджменте: определение, показатели, методы оценки и снижения	Москва: Лаборатория книги, 2012, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=140816
Л2.2	Фирсова О. А.	Управление рисками организаций	Орел: МАБИВ, 2014, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=428622
Л2.3	Фливиборг Б., Брузелиус Н.	Мегапроекты и риски: Анатомия амбиций	Москва: Альпина Паблишер, 2016, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=279751
Л2.4	Шапкин А. С., Шапкин В. А.	Экономические и финансовые риски: оценка, управление, портфель инвестиций	Москва: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2014, http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=426438
Л2.5	Крышкин О.	Настольная книга по внутреннему аудиту: Риски и бизнес-процессы	Москва: ООО "Альпина Паблишер", 2013, http://znanium.com/go.php?id=520721

6.1.3. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Абалкин Л.И.	Краткий экономический словарь	Москва: Политиздат, 1989,
Л3.2	Карус О.И.	Учет денежных средств, денежных документов и расчетов с подотчетными лицами: Метод. указания	Хабаровск: Изд-во ДВГУПС, 2004,
Л3.3	Слагода В. Г.	Краткий экономический словарь	Москва: Издательство "ФОРУМ", 2009, http://znanium.com/go.php?id=158806

6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины (модуля)

Э1		
Э2		

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

6.3.1 Перечень программного обеспечения

Zoom (свободная лицензия)
Microsoft Windows Professional 8, лиц. 61442171

Антивирус Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – Расширенный Russian Edition - Антивирусная защита, контракт 469 ДВГУПС

6.3.2 Перечень информационных справочных систем

Профессиональная база данных, информационно-справочная система Консультант - <https://www.consultant.ru/>

Профессиональная база данных, информационно-справочная система Гарант - <https://www.garant.ru/>

7. ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)

Аудитория	Назначение	Оснащение
1603	Учебная аудитория для проведения практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.	Комплект учебной мебели, доска, мультимедиапроектор переносной.
352	Учебная аудитория для проведения практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.	Комплект учебной мебели, доска, ПК, мультимедиапроектор переносной. Windows 10 Pro - MS DreamSpark, лиц. 700594875, Microsoft Office Профессиональный плюс 2007 – 43107380. Foxit Reader, Антивирус Kaspersky Endpoint Security для бизнеса – Расширенный Russian Edition. 1500-2499 Node 1 year Educational Renewal License* Контракт 171 ДВГУПС от 01.10.2021, до 01.10.2022
354	Учебная аудитория для проведения практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.	Комплект учебной мебели, доска, экран переносной, мультимедиапроектор переносной.
1303	Помещения для самостоятельной работы обучающихся. Читальный зал НТБ	Тематические плакаты, столы, стулья, стеллажи Компьютерная техника с возможностью подключения к сети Интернет, свободному доступу в ЭБС и ЭИОС.

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Лекция

Работа на лекции является очень важным видом студенческой деятельности для изучения дисциплины, т.к. лектор дает нормативно-правовые акты, которые в современной России подвержены частому, а иногда кардинальному изменению, что обуславливает «быстрое устаревание» учебного материала, изложенного в основной и дополнительной учебной литературе. Лектор ориентирует студентов в действующем законодательстве Российской Федерации и соответственно в учебном материале. Краткие записи лекций (конспектирование) помогает усвоить материал. Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометить важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Конспект лучше подразделять на пункты, параграфы, соблюдая красную строку. Принципиальные места, определения, формулы следует сопровождать замечаниями: «важно», «особо важно», «хорошо запомнить» и т.п. или подчеркивать красной ручкой. Целесообразно разработать собственную символику, сокращения слов, что позволит сконцентрировать внимание студента на важных сведениях. Прослушивание и запись лекции можно производить при помощи современных устройств (диктофон, ноутбук, нетбук и т.п.). Работая над конспектом лекций, всегда следует использовать не только учебник, но и ту литературу, которую дополнительно рекомендовал лектор, в том числе нормативно-правовые акты соответствующей направленности. По результатам работы с конспектом лекции следует обозначить вопросы, термины, материал, который вызывают трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удается разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии. Лекционный материал является базовым, с которого необходимо начать освоение соответствующего раздела или темы.

Практические занятия Проработка рабочей программы дисциплины, уделяя особое внимание целям и задачам, структуре и содержанию дисциплины. Ознакомление с темами и планами практических занятий. Анализ основной нормативно-правовой и учебной литературы, после чего работа с рекомендованной дополнительной литературой.

Подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы, работа с текстами нормативно-правовых актов. Прослушивание аудио- и видеозаписей по заданной теме, решение задач выданных студенту для решения самостоятельно. Устные ответы студентов по контрольным вопросам на практических занятиях. Ответы должны быть компактными и вразумительными, без неоправданных отступлений и рассуждений. Студент должен излагать (не читать) изученный материал свободно. В случае неточностей и (или) непонимания какого-либо вопроса пройденного материала студенту следует обратиться к преподавателю для получения необходимой консультации и разъяснения возникшей ситуации.

Расчетно-графическая работа (РГР). РГР выполняется с целью закрепления знаний, полученных студентом в ходе лекционных и семинарских занятий и приобретения навыков самостоятельного понимания и применения нормативно-правовых актов и специальной литературой. Написание РГР призвано оперативно установить степень усвоения студентами учебного материала дисциплины и формирования соответствующих компетенций. РГР может включать знакомство с основной, дополнительной и нормативной литературой, включая справочные издания, зарубежные источники, конспект основных положений, терминов, сведений, требующих для запоминания и являющихся основополагающими в теме и (или) составление аннотаций к прочитанным литературным источникам, решение конкретных правовых вопросов, задач и юридических казусов. Содержание подготовленного студентом ответа на поставленные вопросы РГР должно показать

знание студентом теории вопроса и практического ее разрешения.

Подготовка к зачету.

При подготовке к зачету необходимо ориентироваться на конспекты лекций, рабочую программу дисциплины, нормативную, учебную и рекомендуемую литературу. Основное в подготовке к сдаче зачета - это повторение всего материала дисциплины. При подготовке к зачету студент весь объем работы должен распределять равномерно по дням, отведенным для подготовки, контролировать каждый день выполнение намеченной работы. В период подготовки к зачету студент вновь обращается к уже изученному (пройденному) учебному материалу. Подготовка студента включает в себя три этапа: самостоятельная работа в течение семестра; непосредственная подготовка в дни, предшествующие зачету по темам курса; Зачет проводится по вопросам или тестам, охватывающим весь пройденный материал дисциплины, включая вопросы, отведенные для самостоятельного изучения.

Самостоятельная работа проводится с целью: систематизации и закрепления полученных теоретических знаний и практических умений обучающихся; углубления и расширения теоретических знаний студентов; формирования умений использовать нормативную, правовую, справочную документацию, учебную и специальную литературу; развития познавательных способностей и активности обучающихся: творческой инициативы, самостоятельности, ответственности, организованности; формирование самостоятельности мышления, способностей к саморазвитию, совершенствованию и самоорганизации; формирования профессиональных компетенций; развитию исследовательских умений студентов. Формы и виды самостоятельной работы студентов: чтение основной и дополнительной литературы – самостоятельное изучение материала по рекомендуемым литературным источникам; работа с библиотечным каталогом, самостоятельный подбор необходимой литературы; работа со словарем, справочником; поиск необходимой информации в сети Интернет; конспектирование источников; реферирование источников; составление аннотаций к прочитанным литературным источникам; составление рецензий и отзывов на прочитанный материал; составление обзора публикаций по теме; составление и разработка терминологического словаря; составление хронологической таблицы; составление библиографии (библиографической картотеки); подготовка к различным формам текущей и промежуточной аттестации (к тестированию, контрольной работе, зачету, экзамену); выполнение домашних работ; самостоятельное выполнение практических заданий репродуктивного типа (ответы на вопросы, задачи, тесты). Технология организации самостоятельной работы обучающихся включает использование информационных и материально-технических ресурсов образовательного учреждения:

библиотеку с читальным залом, укомплектованную в соответствии с существующими нормами; учебно-методическую базу учебных кабинетов, лабораторий и зала кодификации; компьютерные классы с возможностью работы в Интернет; аудитории (классы) для консультационной деятельности; учебную и учебно-методическую литературу, разработанную с учетом увеличения доли самостоятельной работы студентов, и иные методические материалы. Перед выполнением обучающимися внеаудиторной самостоятельной работы преподаватель проводит консультирование по выполнению задания, который включает цель задания, его содержания, сроки выполнения, ориентировочный объем работы, основные требования к результатам работы, критерии оценки. Во время выполнения обучающимися внеаудиторной самостоятельной работы и при необходимости преподаватель может проводить индивидуальные и групповые консультации. Самостоятельная работа может осуществляться индивидуально или группами обучающихся в зависимости от цели, объема, конкретной тематики самостоятельной работы, уровня сложности, уровня умений обучающихся. Контроль самостоятельной работы студентов предусматривает: соотнесение содержания контроля с целями обучения; объективность контроля; валидность контроля (соответствие предъявляемых заданий тому, что предполагается проверить); дифференциацию контрольно-измерительных материалов.

Формы контроля самостоятельной работы: просмотр и проверка выполнения самостоятельной работы преподавателем; организация самопроверки, взаимопроверки выполненного задания в группе; обсуждение результатов выполненной работы на занятии; проведение письменного опроса; проведение устного опроса; организация и проведение индивидуального собеседования; организация и проведение собеседования с группой; защита отчетов о проделанной работе. Обеспечение обучающихся инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья печатными и электронными образовательными ресурсами в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья.

Студенты с ограниченными возможностями здоровья, в отличие от остальных студентов, имеют свои специфические особенности восприятия, переработки материала. Подбор и разработка учебных материалов производится с учетом того, чтобы предоставлять этот материал в различных формах так, чтобы инвалиды с нарушениями слуха получали информацию визуально, с нарушениями зрения - аудиально (например, с использованием программ-синтезаторов речи) или с помощью тифло-информационных устройств.

Для освоения дисциплины будут использованы лекционные аудитории, оснащенные досками для письма, мультимедийное оборудование: проектор, проекционный экран. Для проведения семинарских (практических) занятий - мультимедийное оборудование: проектор, проекционный экран.

Освоение дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения:

- лекционная аудитория: мультимедийное оборудование, источники питания для индивидуальных технических средств;
- учебная аудитория для практических занятий (семинаров): мультимедийное оборудование;
- аудитория для самостоятельной работы: стандартные рабочие места с персональными компьютерами.

В каждой аудитории, где обучаются инвалиды и лица с ограниченными возможностями здоровья, предусмотрено соответствующее количество мест для обучающихся с учетом ограничений их здоровья.

Для обучающихся инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья предусмотрено обслуживание по межбиблиотечному абонементу (МБА) с Хабаровской краевой специализированной библиотекой для слепых. По запросу пользователей НТБ инвалидов по зрению, осуществляется информационно-библиотечное обслуживание, доставка и выдача для работы в читальном зале книг в специализированных форматах для слепых.

Проведение учебного процесса может быть организовано с использованием ЭИОС университета и в цифровой среде (группы в социальных сетях, электронная почта, видеосвязь и др. платформы). Учебные занятия с применением ДОТ

проходят в соответствии с утвержденным расписанием. Текущий контроль и промежуточная аттестация обучающихся проводится с применением ДОТ.

Оценочные материалы при формировании рабочих программ дисциплин (модулей)

Направление: 01.04.02 Прикладная математика и информатика

Направленность (профиль): Математическое и информационное обеспечение экономической деятельности

Дисциплина: Управление рисками

Формируемые компетенции:

1. Описание показателей, критериев и шкал оценивания компетенций.

Показатели и критерии оценивания компетенций

Объект оценки	Уровни сформированности компетенций	Критерий оценивания результатов обучения
Обучающийся	Низкий уровень Пороговый уровень Повышенный уровень Высокий уровень	Уровень результатов обучения не ниже порогового

Шкалы оценивания компетенций при сдаче зачета

Достигнутый уровень результата обучения	Характеристика уровня сформированности компетенций	Шкала оценивания
Пороговый уровень	Обучающийся: - обнаружил на зачете всесторонние, систематические и глубокие знания учебно-программного материала; - допустил небольшие упущения в ответах на вопросы, существенным образом не снижающие их качество; - допустил существенное упущение в ответе на один из вопросов, которое за тем было устранено студентом с помощью уточняющих вопросов; - допустил существенное упущение в ответах на вопросы, часть из которых была устранена студентом с помощью уточняющих вопросов	Зачтено
Низкий уровень	Обучающийся: - допустил существенные упущения при ответах на все вопросы преподавателя; - обнаружил пробелы более чем 50% в знаниях основного учебно-программного материала	Не зачтено

Описание шкал оценивания

Компетенции обучающегося оцениваются следующим образом:

Планируемый уровень результатов освоения	Содержание шкалы оценивания достигнутого уровня результата обучения			
	Неудовлетворительн	Удовлетворительно	Хорошо	Отлично
	Не зачтено	Зачтено	Зачтено	Зачтено

Знать	Неспособность обучающегося самостоятельно продемонстрировать наличие знаний при решении заданий, которые были представлены преподавателем вместе с образцом их решения.	Обучающийся способен самостоятельно продемонстрировать наличие знаний при решении заданий, которые были представлены преподавателем вместе с образцом их решения.	Обучающийся демонстрирует способность к самостоятельному применению знаний при решении заданий, аналогичных тем, которые представлял преподаватель, и при его консультативной	Обучающийся демонстрирует способность к самостоятельному применению знаний в выборе способа решения неизвестных или нестандартных заданий и при консультативной поддержке в части междисциплинарных
Уметь	Отсутствие у обучающегося самостоятельности в применении умений по использованию методов освоения учебной дисциплины.	Обучающийся демонстрирует самостоятельность в применении умений решения учебных заданий в полном соответствии с образцом, данным преподавателем.	Обучающийся продемонстрирует самостоятельное применение умений решения заданий, аналогичных тем, которые представлял преподаватель, и при его консультативной поддержке в части современных проблем.	Обучающийся демонстрирует самостоятельное применение умений решения неизвестных или нестандартных заданий и при консультативной поддержке преподавателя в части междисциплинарных связей.
Владеть	Неспособность самостоятельно проявить навык решения поставленной задачи по стандартному образцу повторно.	Обучающийся демонстрирует самостоятельность в применении навыка по заданиям, решение которых было показано преподавателем.	Обучающийся демонстрирует самостоятельное применение навыка решения заданий, аналогичных тем, которые представлял преподаватель, и при его консультативной поддержке в части современных проблем.	Обучающийся демонстрирует самостоятельное применение навыка решения неизвестных или нестандартных заданий и при консультативной поддержке преподавателя в части междисциплинарных связей.

2. Перечень вопросов и задач к экзаменам, зачетам, курсовому проектированию, лабораторным занятиям. Образец экзаменационного билета

Вопросы к зачету

УК-4

1. Риск это –...
2. Характеристика или количественные оценки распределений будущих полезных результатов конкретных решений или проектов, которые порождаются объективно существующей неопределенностью этих результатов; а также учитывает, как положительные, так и отрицательные значения распределения будущих полезных результатов, и шансы их получения – это... (Риск)
3. Неопределенность это – ...
4. Невозможность однозначного определения будущих результатов принимаемых решений – это...(неопределенность)
5. Каковы две основные разновидности неопределенности?
6. Перечислите основные виды неопределенности
7. Назовите основные меры риска
8. Перечислите внешние факторы риска
9. Перечислите внутренние факторы риска
10. Перечислите известные Вам методы управления рисками

ОПК-3

11. Напишите, как рассчитывается коэффициент вариации и поясните что он показывает
12. Мера риска, представляющая собой отношение стандартного отклонения к ожидаемому доходу это.... (коэффициент вариации)

13. Как называется метод анализа риска реализации долгосрочного инвестиционного проекта, опирающийся на общие представления о возможном развитии хозяйственной конъюнктуры, предусматривающий исследование весьма ограниченного числа сценариев ее развития, которые должны описывать наиболее характерные версии будущей реализации рассматриваемого проекта.... (анализ сценариев)

14. Оценка риска на основе представления возможностей реализации долгосрочного инвестиционного проекта в виде ориентированного графика, ветви которого описывают возможные варианты развития будущих событий или состояний окружающей среды по выделенным подпериодам в течении всего периода исполнения проекта, а узлы характеризуют результаты этого проекта в зависимости от развития событий называется.... (дерево событий)

15. Мера риска, рассчитываемая как корень квадратный из дисперсии распределения доходов или иного полезного результата по рисковому активу, портфелю, проекту и характеризующая распределение этих доходов относительно их ожидаемого значения называется..... (стандартное отклонение)

ПК-1

16. Укажите как называется условный срочный контракт, который фирма заключает с целью управления рисками, при котором вторая сторона обязуется выполнить требования договора, если в будущем наступают оговоренные заранее условия.... (реальный опцион)

17. Что такое, по вашему мнению, европейский опцион?

18. Что такое, по вашему мнению, американский опцион?

19. Укажите, как называется позиция, которую занимает покупатель (собственник) условного срочного контракта, при которой предполагается наличие выбора исполнения или неисполнения условий этого контракта ... (длинная позиция)

20. Укажите, как называется позиция, которую занимает одна из сторон условного срочного контракта, не имеющая права выбора исполнения или неисполнения условий данного контракта и выполняющая решения противоположной стороны (короткая позиция)

21. Составляется из рисковых и безрисковых активов и имеет в каждом будущем состоянии экономики такие же доходы, как и рассматриваемая рисковая инвестиция, реализуемый рисковый актив капитала; его стоимость используется для оценки равновесной рыночной цены опциона. Что это? (эквивалентный портфель)

22. Как называется распространенная модель определения равновесной рыночной стоимости опционов при условии непрерывного изменения цены базового актива; опирается на предположение о логарифмически нормальном распределении цены базового актива; в условиях реального бизнеса широко используется для оценки стоимости многопериодных рисковых инвестиций (формула Блэка-Шоулза)

23. Как называется определенный вид защитной стратегии, при котором происходит передача изменения цен другому лицу в форме продажи срочного контракта, например, рыночного опциона; предусматривает сужение распределения полезных результатов в части как благоприятных, так и неблагоприятных исходов и соответственно, снижение риска (хеджирование риска изменения цен).

24. Дайте определение, что такое хеджирование?

25. Дайте определение что такое страхование риска?

3. Тестовые задания. Оценка по результатам тестирования.

Риск это

- а) наступление неблагоприятных событий
- б) вероятность наступления неблагоприятных событий
- в) наступление благоприятных событий

Риск порождается:

- а) определенностью
- б) неопределенностью
- в) вероятностью

Риск измеряется

- а) вероятностью
- б) чистой приведенной стоимостью
- в) среднеквадратическим отклонением

Полный комплект тестовых заданий в корпоративной тестовой оболочке АСТ размещен на сервере УИТ ДВГУПС, а также на сайте Университета в разделе СДО ДВГУПС (образовательная среда в личном кабинете преподавателя).

Соответствие между балльной системой и системой оценивания по результатам тестирования устанавливается посредством следующей таблицы:

Объект оценки	Показатели оценивания результатов обучения	Оценка	Уровень результатов обучения
Обучающийся	60 баллов и менее	«Неудовлетворительно»	Низкий уровень
	74 – 61 баллов	«Удовлетворительно»	Пороговый уровень
	84 – 75 баллов	«Хорошо»	Повышенный уровень
	100 – 85 баллов	«Отлично»	Высокий уровень

4. Оценка ответа обучающегося на вопросы, задачу (задание) экзаменационного билета, зачета, курсового проектирования.

Оценка ответа обучающегося на вопросы, задачу (задание) экзаменационного билета, зачета

Элементы оценивания	Содержание шкалы оценивания			
	Неудовлетворительн	Удовлетворитель	Хорошо	Отлично
	Не зачтено	Зачтено	Зачтено	Зачтено
Соответствие ответов формулировкам вопросов (заданий)	Полное несоответствие по всем вопросам.	Значительные погрешности.	Незначительные погрешности.	Полное соответствие.
Структура, последовательность и логика ответа. Умение четко, понятно, грамотно и свободно излагать свои мысли	Полное несоответствие критерию.	Значительное несоответствие критерию.	Незначительное несоответствие критерию.	Соответствие критерию при ответе на все вопросы.
Знание нормативных, правовых документов и специальной литературы	Полное незнание нормативной и правовой базы и специальной литературы	Имеют место существенные упущения (незнание большей части из документов и специальной литературы по названию, содержанию и т.д.).	Имеют место несущественные упущения и незнание отдельных (единичных) работ из числа обязательной литературы.	Полное соответствие данному критерию ответов на все вопросы.
Умение увязывать теорию с практикой, в том числе в области профессиональной работы	Умение связать теорию с практикой работы не проявляется.	Умение связать вопросы теории и практики проявляется редко.	Умение связать вопросы теории и практики в основном проявляется.	Полное соответствие данному критерию. Способность интегрировать знания и привлекать сведения из различных научных сфер.
Качество ответов на дополнительные вопросы	На все дополнительные вопросы преподавателя даны неверные ответы.	Ответы на большую часть дополнительных вопросов преподавателя даны неверно.	1. Даны неполные ответы на дополнительные вопросы преподавателя. 2. Дан один неверный ответ на дополнительные вопросы преподавателя.	Даны верные ответы на все дополнительные вопросы преподавателя.

Примечание: итоговая оценка формируется как средняя арифметическая результатов элементов оценивания.