

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Маланичева Наталья Николаевна
Должность: директор филиала
Дата подписания: 17.04.2023 10:37:59
Уникальный программный ключ:
94732c3d953a82d495d5c5155d5c5738831edd18

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПУТЕЙ СООБЩЕНИЯ
(СамГУПС)

Филиал СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

РАССМОТРЕНА
на заседании Ученого совета филиала
СамГУПС в г. Нижнем Новгороде
протокол от 07 мая 2019 г. № 11

УТВЕРЖДАЮ
Заместитель директора филиала
по учебной работе

Н. В. Пшениснов



**Учет и анализ рисков на транспортных
предприятиях**

рабочая программа дисциплины

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль) «Экономика предприятий
железнодорожного транспорта»

Форма обучения: заочная

Нижний Новгород 2019

Программу составила: Галанина Е.Г.

Рабочая программа разработана в соответствии с ФГОС:
Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика утвержден приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от «12» ноября 2015 г. № 1327.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины».

Протокол от «20» апреля 2019 г. № 8.

Зав. кафедрой, канд. техн. наук, проф. _____




Подпись

И.В. Каспаров

Лист переутверждения РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2020-2021 учебном году на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины»
с изменениями/дополнениями

Протокол от «16» мая 2020 г. № 9

Зав. кафедрой, канд. тех. наук, профессор  И.В. Каспаров

Согласовано и переутверждено:


решением Ученого совета филиала СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

Протокол от «23» июня 2020 г. № 1

Лист переутверждения РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2021-2022 учебном году на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины»
с изменениями/дополнениями

Протокол от «15» мая 2021 г. № 9

Зав. кафедрой, канд. тех. наук, профессор  И.В. Каспаров

Согласовано и переутверждено:


решением Ученого совета филиала СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

Протокол от «22» июня 2021 г. № 3

Лист переутверждения РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2022-2023 учебном году на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины»
с изменениями/дополнениями

Протокол от «21» мая 2022 г. № 9

Зав. кафедрой, канд. тех. наук, профессор  И.В. Каспаров

Согласовано и переутверждено:

решением Ученого совета филиала СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

Протокол от «28» июня 2022 г. № 1

Лист переутверждения РПД для исполнения в очередном учебном году

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2023-2024 учебном году на заседании кафедры «Общеобразовательные и профессиональные дисциплины»
с изменениями/дополнениями

Протокол от «__» _____ 2023 г. № ____

Зав. кафедрой, канд. тех. наук, профессор _____ И.В. Каспаров

Согласовано и переутверждено:

решением Ученого совета филиала СамГУПС в г. Нижнем Новгороде

Протокол от «__» _____ 2023 г. № ____

**Лист актуализации РПД «Учет и анализ рисков на транспортных предприятиях»
на 2020-2021 учебный год**

Актуализируется:

раздел 7. Перечень основной и дополнительной литературы

7.1. Основная литература				
№ п/п	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество
Л1.1	Герасимов, А.Н.	Оценка и анализ рисков : учебник (для бакалавров)	Москва : КноРус, 2019. — 251 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/930003	Электронный ресурс
Л1.2	Авдийский В.И.	Теория и практика управления рисками организации : учебник	Москва : КноРус, 2018. — 275 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/926293	Электронный ресурс
7.2. Дополнительная литература				
Л2.1	Багратуни К.Ю., Данилина М.В.	Риски: анализ и оценка : учебное пособие	Москва: Русайнс, 2020. — 136 с. — Режим доступа: https://book.ru/book/935149	Электронный ресурс

Зав. кафедрой, канд. техн. наук, проф. _____



подпись

И.В. Каспаров

**Лист актуализации РПД «Учет и анализ рисков на транспортных предприятиях»
на 2021-2022 учебный год
Актуализируется:**

раздел 7. Перечень основной и дополнительной литературы

7.1. Основная литература				
№ п/п	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество
Л1.1	Воронцовский А.В.	Управление рисками : учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2020. — 485 с. — Режим доступа: https://urait.ru/bcode/450664	Электронный ресурс
Л1.2	Герасимов, А.Н.	Оценка и анализ рисков : учебник (для бакалавров)	Москва : КноРус, 2019. — 251 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/930003	Электронный ресурс
Л1.3	Авдийский В.И.	Теория и практика управления рисками организации : учебник	Москва : КноРус, 2018. — 275 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/926293	Электронный ресурс
7.2. Дополнительная литература				
Л2.1	Багратуни К.Ю., Данилина М.В.	Риски: анализ и оценка : учебное пособие	Москва: Русайнс, 2020. — 136 с. — Режим доступа: https://book.ru/book/935149	Электронный ресурс

Зав. кафедрой, канд. техн. наук, проф. _____



И.В. Каспаров

**Лист актуализации РПД «Учет и анализ рисков на транспортных предприятиях»
на 2022-2023 учебный год**

Актуализируется:

раздел 7. Перечень основной и дополнительной литературы

7.1. Основная литература				
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество
Л1.1	Герасимов, А.Н.	Оценка и анализ рисков : учебник	Москва: КноРус, 2022. — 251 с. - Режим доступа https://book.ru/books/943147	Электронный ресурс
Л2.1	Е.А. Остапенко, С.А. Молчаненко; под общ. ред. Т.Г. Гурнович	Оценка и анализ рисков : учебник	Москва : КноРус, 2022. - 251 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/943147	Электронный ресурс
7.2. Дополнительная литература				
Л2.1	Струченкова, Т.В.	Валютные риски: анализ и управление : учебное пособие	Москва: КноРус, 2016. - 210 с. - Режим доступа https://www.book.ru/book/920593	Электронный ресурс
Л2.2	Струченкова, Т.В.	Валютные риски: анализ и управление : учебное пособие	Москва: КноРус, 2021. - 210 с. - Режим доступа https://book.ru/books/936298	Электронный ресурс

Зав. кафедрой, канд. техн. наук, проф. _____



ПОДПИСЬ

И.В. Каспаров

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

1.1. Цели и задачи дисциплины

Целями освоения учебной дисциплины «Учет и анализ рисков на транспортных предприятиях» являются:

- формирование у обучающегося компетенций в соответствии с требованиями федерального государственного образовательного стандарта;
- создание теоретической и методологической основы для овладения знаниями в области учета и анализа рисков на транспортных предприятиях;
- формирование представлений по учету и анализу рисков.

Основными задачами изучения дисциплины «Учет и анализ рисков на транспортных предприятиях» являются формирование у студентов знаний о закономерностях функционирования организации в условиях риска, методах управления рисками, принципах разработки, оценки эффективности и реализации решений по управлению рисками, обучение методам систематизации и обобщения информации о рисках деятельности организации, выработка навыков использования количественных и качественных методов идентификации и анализа рисков.

1.2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Компетенции, формируемые в процессе изучения дисциплины	Результаты освоения учебной дисциплины
ПК-11. Способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	Знать: <ul style="list-style-type: none">- виды рисков на транспортном предприятии;- варианты управленческих решений в условиях рисков;- основные методологические подходы к оценке рисков на транспортных предприятиях
	Уметь: <ul style="list-style-type: none">- анализировать виды рисков на транспортном предприятии;- разработать и обосновать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев социально-экономической эффективности;- оценивать риски и возможные социально-экономические последствия
	Владеть: <ul style="list-style-type: none">- видами рисков на транспортном предприятии;- методами оценки варианта управленческих решений в условиях риска;- методикой оценки риска и возможных социально-экономических последствий

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Учебная дисциплина «Учет и анализ рисков на транспортных предприятиях» относится к вариативной части раздела ФТД Факультативы.

Код	Наименование дисциплины	Коды
-----	-------------------------	------

дисциплины		формируемых компетенций
Осваиваемая дисциплина		
ФТД.В.02	Учет и анализ рисков на транспортных предприятиях	ПК-11
Предшествующие дисциплины		
	Нет	
Дисциплины, осваиваемые параллельно		
Б1.В.04	Финансовый менеджмент на железнодорожном транспорте	ПК-11
Б1.В.05	Управленческий учет на железнодорожном транспорте	ПК-11
Последующие дисциплины		
Б1.В.05	Управленческий учет на железнодорожном транспорте	ПК-11
Б1.В.09	Экономическая оценка инвестиций на железнодорожном транспорте	ПК-11
Б1.В.ДВ.06.01	Аналитическое обоснование конкурентоспособных бизнес - моделей	ПК-11
Б1.В.ДВ.06.02	Аутсорсинг на транспорте	ПК-11
Б2.В.05(Пд)	Производственная практика, преддипломная практика	ПК-11
Б3.Б.01	Защита выпускной квалификационной работы, включая подготовку к процедуре защиты и процедуру защиты	ПК-11
ФТД.В.03	Организация доступной среды на транспорте	ПК-11

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

3.1. Распределение объема учебной дисциплины на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	Всего часов по учебному плану	Курсы
		3
Общая трудоемкость дисциплины:		
- часов	72	72
- зачетных единиц	2	2
Контактная работа обучающихся с преподавателем (всего), часов	8,25	8,25
<i>из нее аудиторные занятия, всего</i>	8,25	8,25
в т.ч. лекции	4	4
практические занятия	4	4
лабораторные работы		
КЭ	0,25	0,25
Самостоятельная подготовка к экзаменам в период экзаменационной сессии (контроль)	3,75	3,75
Самостоятельная работа	60	60
в том числе на выполнение:		
контрольной работы		
расчетно-графической работы		
реферата		
курсовой работы		
курсового проекта		
Виды промежуточного контроля	За	За
Текущий контроль (вид, количество)	-	-

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

4.1. Темы и краткое содержание курса

ТЕМА 1. ПОНЯТИЕ РИСКА И ЕГО ПРИРОДА

Полная неопределенность. Частичная неопределенность. Ситуация риска (рискованная ситуация). Характерные черты рискованных ситуаций. Субъект риска (носитель риска). Составляющие элементы риска. Функции риска. Характеристики риска. Взгляды представителей экономических школ на риск.

ТЕМА 2. РИСКИ ВНЕШНЕЙ И ВНУТРЕННЕЙ СРЕДЫ

Риски внешней среды организации. Риски макросреды. Отраслевые риски. Риски ауры. Внешние риски. Экономическая система. Технологическая система. Информационные и социальные системы. Внутренние риски.

ТЕМА 3. ДИАГНОСТИКА РИСКОВ КОМПАНИИ

Суть диагностики рисков. Зоны риска. Виды диагностики. Этапы диагностики. Картографирование рисков фирмы.

ТЕМА 4. МЕТОДЫ ОЦЕНКИ РИСКОВ

Метод оценки. Качественные методы. Количественные методы оценки риска. Оценка показателей риска на основе анализа экономических показателей. Вероятностные показатели оценки риска. Статистические показатели риска.

ТЕМА 5. МАКРОЭКОНОМИЧЕСКИЕ И ПОЛИТИЧЕСКИЕ РИСКИ

Макроэкономические риски. Политический риск. Источники политического риска. Виды политического риска. Методы оценки политического риска

ТЕМА 6. РИСКИ ОТНОШЕНИЙ В АЛЬЯНСАХ

Риск, связанный с формированием стратегии альянса. Риски, связанные с ресурсами альянсов. Особенность рисков отношений в альянсе.

ТЕМА 7. РИСКИ, СВЯЗАННЫЕ С ЧЕЛОВЕЧЕСКИМ ФАКТОРОМ

Виды рисков: поведенческие риски; риск конфликтов; риск нелояльности; риск некомпетентности и непрофессионализма.

ТЕМА 8. ОПЕРАЦИОННЫЕ РИСКИ И ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ

Операционный риск. Финансовый риск. Причины операционных рисков. Причины операционных рисков. Риски, связанные с покупательной способностью денег. Риски, связанные с вложением капитала (инвестиционные риски).

ТЕМА 9. МЕТОДЫ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

Метод управления рисками. Этапы управления рисками. Перенос и передача риска. Уклонение от риска и избегание. Самострахование. Распределение и диссипация риска. Диверсификация и концентрация риска. Лимитирование концентрации риска. Прямое директивное управление риском.

Страхование риска. Хеджирование риска. Организационная структура службы управления рисками

4.2. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам

Названия разделов и тем	Всего часов по учебному плану	Виды учебных занятий		СР
		Контактная работа (аудиторная работа)		
		ЛЗ	ПЗ	
Тема 1. Понятие риска и его природа	11	1		10
Тема 2. Риски внешней и внутренней среды	10			10
Тема 3. Диагностика рисков компании	8	1		7
Тема 4. Методы оценки рисков	8	1	2	5
Тема 5. Макроэкономические и политические риски	6			6
Тема 6. Риски отношений в альянсах	6			6
Тема 7. Риски, связанные с человеческим фактором	6			6
Тема 8. Операционные риски и финансовые риски	6			6
Тема 9. Методы управления рисками	7	1	2	4
КЭ	0,25			
Контроль	3,75			
Всего	72	4	4	60

4.3. Тематика практических занятий

Тема практического занятия	Количество часов
Методы оценки рисков	2
Методы управления рисками	2
Всего	4

4.4. Тематика лабораторных работ

Лабораторные работы учебным планом не предусмотрены.

4.5. Тематика курсовых работ (проектов)

Курсовые работы (проекты) учебным планом не предусмотрены.

4.6. Тематика контрольных работ

Контрольные работы учебным планом не предусмотрены.

4.7. Тематика рефератов

Рефераты учебным планом не предусмотрены.

5. Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

5.1. Распределение часов по темам и видам самостоятельной работы

Разделы и темы	Всего часов по учебному плану	Вид самостоятельной работы
Тема 1. Понятие риска и его природа	10	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами

Тема 2. Риски внешней и внутренней среды	10	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 3. Диагностика рисков компании	7	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 4. Методы оценки рисков	5	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 5. Макроэкономические и политические риски	6	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 6. Риски отношений в альянсах	6	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 7. Риски, связанные с человеческим фактором	6	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 8. Операционные риски и финансовые риски	6	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Тема 9. Методы управления рисками	4	Самостоятельное изучение отдельных тем учебной литературы. Работа со справочной и специальной литературой. Подготовка к промежуточной аттестации. Работа с профессиональными базами данных и Интернет ресурсами
Всего	60	

5.2. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы студентов с указанием места их нахождения:

- учебная литература - библиотека филиала и ЭБС;
- методические рекомендации по самостоятельной работе - сайт филиала.

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

Виды оценочных средств	Количество
Текущий контроль	
Контрольная работа	-
Промежуточный контроль	

Зачет	1
-------	---

Фонд оценочных средств представлен в приложении к рабочей программе.

7. Перечень основной и дополнительной литературы

7.1. Основная литература				
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Количество
Л1.1	Герасимов, А.Н.	Оценка и анализ рисков : учебник (для бакалавров)	Москва : КноРус, 2019. - 251 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/930003	Электронный ресурс
Л1.2	Авдийский В.И.	Теория и практика управления рисками организации : учебник	Москва : КноРус, 2018. - 275 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/926293	Электронный ресурс
7.2. Дополнительная литература				
Л2.1	Данилина М.В., Багратуни К.Ю.	Риски: анализ и оценка : учебное пособие	Москва : Русайнс, 2016. - 136 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/921913	Электронный ресурс
Л2.2	Струченкова, Т.В.	Валютные риски: анализ и управление : учебное пособие	Москва : КноРус, 2016. - 210 с. - Режим доступа: https://book.ru/book/920593	Электронный ресурс

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

1. Официальный сайт филиала.
2. Электронные библиотечные системы.

9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

1. Лекционные занятия включают в себя конспектирование учебного материала, на занятиях необходимо иметь тетрадь для записи и необходимые канцелярские принадлежности.

2. Практические занятия включают в себя решение задач по темам. Для подготовки к практическим занятиям необходимо заранее ознакомиться с рекомендованной литературой. На занятии необходимо иметь конспект лекции, методические указания по выполнению заданий. Во время выполнения заданий студент заполняет отчет, который защищает у преподавателя в конце занятия.

10. Перечень информационных технологий, программного обеспечения и информационных справочных систем, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

При осуществлении образовательного процесса по дисциплине используются следующие информационные технологии и программное обеспечение:

- для проведения лекций, демонстрации презентаций и ведения интерактивных занятий: MS PowerPoint;
- для выполнения практических занятий - Microsoft Office 2003 и выше;
- для самостоятельной работы студентов: Windows 7 и выше, Microsoft Office 2003 и выше;
- для оформления отчетов и иной документации: Microsoft Office 2003 и выше;

- ЭИОС- Moodle.

Профессиональные базы данных,

используемые для изучения дисциплины (свободный доступ)

1. База статистических данных «Финансово-экономические показатели РФ»
- <https://www.minfin.ru/ru/statistics>

2. Федеральная служба государственной статистики. - Режим доступа:
<http://www.gks.ru>

3. Территориальный орган Федеральной службы государственной статистики по Нижегородской области. - Режим доступа: <http://nizhstat.gks.ru/>

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

11.1. Требования к аудиториям (помещениям, кабинетам) для проведения занятий с указанием соответствующего оснащения

Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации - кабинет «Экономики», аудитория № 602. Специализированная мебель: столы ученические - 23 шт., стулья ученические - 46 шт., доска настенная - 1 шт., стол преподавателя - 1 шт., стул преподавателя - 1 шт. Технические средства обучения, служащие для представления учебной информации большой аудитории: переносной экран, переносной проектор, ноутбук. Учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации, соответствующие рабочей учебной программе дисциплины - комплект презентаций (хранится на кафедре).

11.2. Перечень лабораторного оборудования

Лабораторное оборудование не предусмотрено.

**ФОНД
ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

по учебной дисциплине

**УЧЕТ И АНАЛИЗ РИСКОВ
НА ТРАНСПОРТНЫХ ПРЕДПРИЯТИЯХ**

1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения учебной дисциплины

1.1. Перечень компетенций

ПК-11. Способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий.

1.2. Этапы формирования компетенций в процессе освоения учебной дисциплины

Наименование этапа	Содержание этапа (виды учебной работы)	Коды формируемых на этапе компетенций
Этап 1. Формирование теоретической базы знаний	Лекции, самостоятельная работа студентов с теоретической базой, практические занятия	ПК-11
Этап 2. Формирование умений	Практические занятия	ПК-11
Этап 3. Формирование навыков практического использования знаний и умений	Практические занятия	ПК-11
Этап 4. Проверка усвоенного материала	Зачет	ПК-11

2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

2.1. Показатели и критерии оценивания компетенций на различных этапах их формирования

Этап формирования компетенции	Код компетенции	Показатели оценивания компетенций	Критерии	Способы оценки
Этап 1. Формирование теоретической базы знаний	ПК-11	- посещение лекционных занятий, практических занятий; - ведение конспекта лекций; - участие в обсуждении теоретических вопросов тем на каждом практическом занятии	- наличие конспекта лекций по всем темам, вынесенным на лекционное обсуждение; - активное участие студента в обсуждении теоретических вопросов	устный ответ
Этап 2. Формирование умений (решение задачи по образцу)	ПК-11	- выполнение практических заданий	- успешное самостоятельное выполнение практических заданий	отчет по практическому занятию
Этап 3. Формирование навыков	ПК-11	- выполнение практических заданий	- успешное самостоятельное выполнение	отчет по практическому занятию

практического использования знаний и умений			практических заданий	
Этап 4. Проверка усвоенного материала	ПК-11	- зачет	- ответы на вопросы к зачету	устный ответ

2.2. Критерии оценивания компетенций по уровню их сформированности

Код компетенции	Уровни сформированности компетенций		
	базовый	средний	высокий
ПК-11	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - виды рисков на транспортном предприятии <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - анализировать виды рисков на транспортном предприятии <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - видами рисков на транспортном предприятии 	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - варианты управленческих решений в условиях рисков <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - разработать и обосновать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев социально-экономической эффективности <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - методами оценки варианта управленческих решений в условиях риска 	<p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - основные методологические подходы к оценке рисков на транспортных предприятиях <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - оценивать риски и возможные социально-экономические последствия <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - методикой оценки риска и возможных социально-экономических последствий

2.3. Шкалы оценивания формирования компетенций

а) Шкала оценивания зачета

Шкала оценивания	Критерии оценивания
Зачтено	<p>Студент:</p> <ul style="list-style-type: none"> - прочно усвоил предусмотренной программой материал; - правильно, аргументировано ответил на все вопросы; - показал глубокие систематизированные знания, владеет приемами рассуждения и сопоставляет материал из разных источников: теорию связывает с практикой, другими темами данного курса, других изучаемых предметов; - без ошибок выполнил практическое задание.
Не зачтено	<p>Выставляется студенту, который не справился с 50% вопросов и заданий билета, в ответах на другие вопросы допустил существенные ошибки. Не может ответить на дополнительные вопросы, предложенные преподавателем.</p>

3. Типовые контрольные задания и иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков, характеризующих этапы формирования компетенций

Код компетенции	Этапы формирования компетенции	Типовые задания (оценочные средства)
ПК-11	Этап 1. Формирование теоретической базы знаний	- устный ответ
	Этап 2. Формирование умений (решение задачи по образцу)	- практическое занятие

	Этап 3. Формирование навыков практического использования знаний и умений	- практическое занятие
	Этап 4. Проверка усвоенного материала	- вопросы к зачету (приложение 1)

4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений и навыков

Зачет

Проводится в заданный срок, согласно графику учебного процесса. Зачет проходит в форме собеседования. При оценивании знаний учитывается уровень приобретенных компетенций студента. Аудиторное время, отведенное студенту, на подготовку – 30 мин.

Практические занятия

Практические занятия - метод репродуктивного обучения, обеспечивающий связь теории и практики, содействующий выработке у студентов умений и навыков применения знаний, полученных на лекции и в ходе самостоятельной работы.

Цель работ - привить навыки решения задач и сформировать экономическое мышление в сфере учета и анализа рисков на транспортных предприятиях.

ВОПРОСЫ К ЗАЧЕТУ

Вопросы для проверки уровня обученности «ЗНАТЬ»

1. Сущность риска.
2. Что означает полная неопределенность.
3. Что означает частичная неопределенность.
4. Характерные черты рисковых ситуаций.
5. Составляющие элементы риска.
6. Функции риска.
7. Характеристики риска.
8. Перечислите риски внешней среды организации.
9. Перечислите риски макросреды.
10. Перечислите внутренние риски предприятия.
11. Виды диагностики риска.
12. Этапы диагностики риска.
13. Методы управление рисками.
14. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
15. Существенные признаки рисков.
16. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.
17. Концепция конфликта целей в организации.
18. Неопределенность, ее роль в развитии организации.
19. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.
20. Как влияет риска на эффективность управления.
21. Управленческое решение как объект управления рисками.
22. Управление рисками на индивидуальном уровне: основные характеристики объекта управления.
23. Характеристика операционного риска.
24. Характеристика финансового риска.
25. Причины операционных рисков.
26. Риски, связанные с покупательной способностью денег.
27. Риски, связанные с вложением капитала (инвестиционные риски).
28. Как делятся риски по уровню финансовых потерь.
29. Какой метод оценки риска, используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий.
30. Какой метод оценки риска, представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты.

Вопросы для проверки уровня обученности «УМЕТЬ»

1. Сформулируйте метод избегания рисков.
2. Сформулируйте метод принятия рисков на себя.
3. Сформулируйте метод предотвращения убытков.
4. Сформулируйте метод уменьшения размера убытков.
5. Сформулируйте метод страхования.

6. Сформулируйте метод самострахования.
7. Сформулируйте метод передачи рисков.
8. Сформулируйте принципы использования и комбинирования методов управления рисками.
9. Сформулируйте методологические принципы оценки рисков.
10. Использовать методические и операционные принципы оценки рисков.
11. Сформулируйте количественные методы оценки рисков.
12. Сформулируйте качественные методы оценки рисков.
13. Сформулируйте моделирование в управлении рисками.
14. Что является объектом управления в риск-менеджменте.
15. Что представляет собой анализ риска.
16. Дайте характеристику понятия кривая риска.
17. Какие показатели оценки риска могут быть использованы в условиях определенности?
18. Какой статистический показатель оценки риска, характеризующий отклонение крайних значений результата от среднего.
19. Какие есть недостатки статистических показателей оценки риска.
20. Сформулируйте понятие идентификация риска.
21. Какие риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль?
22. Как называются риски, которые практически всегда несут в себе потери?
23. Как называются риски, которые обусловлены деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией?
24. Чем измеряется величина или степень риска?
25. В чем состоит социально-экономическая функция риска?
26. Каким образом можно учитывать риск при расчете чистой приведенной стоимости?
27. Перечислите субъект управления в риск-менеджменте.
28. В чем сущность статистических методов для оценки рисков.
29. В чем смысл коэффициента вариации как критерия оценки риска.
30. В чем заключается сущность анализа безубыточности.

Проверка уровня обученности «ВЛАДЕТЬ»

1. Рассчитайте количественную оценку риска

У - ущерб в результате наступления рисковогo события - 4568 д.е.

Р - вероятность наступления риска – 0,3

П – планируемая прибыль – 2564 д.е.

2. Требуется выбрать вариант из имеющихся двух, связанных с реализацией продукции. При этом возможный ущерб в первом варианте в случае нереализации продукции 1- го вида – 10 млн. р., во втором варианте – 5 млн. р. Вероятность того, что 1-й вид продукции будет реализован – 0,25, а 2-й – 0,05.

3. Определить ожидаемую прибыль по мероприятию А. Исходные данные. От мероприятия А ожидается получение прибыли в сумме 30 тыс. руб. вероятностью 0,6.

4. Определить ожидаемую прибыль по мероприятию Б. От мероприятия Б ожидается получение прибыли в сумме 20 тыс. р. с вероятностью 0,4.

5. Определить ожидаемую прибыль по мероприятию А и по мероприятию Б, а также общую ожидаемую прибыль. Исходные данные. Имеется два варианта вложения капитала в мероприятие А и Б. От мероприятия А ожидается получение прибыли в сумме 10 тыс. р. вероятностью 0,6. От мероприятия Б ожидается получение прибыли в сумме 20 тыс. р. с вероятностью 0,4.

Оценочные средства

ПК-11. Способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий.

Тестовые задания

1. Идентификация риска это:

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

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

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

2. Что подразумевается под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков _____

3. Что такое риск?

а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели

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

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

4. Риски по уровню финансовых потерь делятся на:

а) допустимый, критический и катастрофический

б) недопустимый, допустимый и критический

в) критический, катастрофический и недопустимый

5. Определите соответствие уровня риска и финансовых потерь

1. Допустимый

2. Критический
3. Катастрофический
- а) выручка равна затратам
- б) потеря прибыли
- в) банкротство

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

- а) природно-климатические
- б) антропогенные
- в) социально-бытовые

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

8. Рассчитайте количественную оценку риска

У - ущерб в результате наступления рискового события - 4568 д.е.

Р - вероятность наступления риска – 0,3

П – планируемая прибыль – 2564 д.е.

9. Социально-экономическая функция риска состоит в следующем:

- а) в том, что в процессе рыночной деятельности риск и конкуренция позволяет выделить социальные группы эффективных собственников в общественных классах, а в экономике – отрасли деятельности, в которых риск приемлем
- б) в том, что реализация риска может обеспечить дополнительную по сравнению с плановой прибыль в случае благоприятного исхода
- в) оба варианта верны

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

- а) имитационное моделирование
- б) вероятностный метод
- в) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- г) построение дерева решений
- д) анализ чувствительности
- е) метод сценариев

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

- а) учет рисков при расчете чистой приведенной стоимости
- б) анализ чувствительности
- в) построение дерева решений
- г) вероятностный метод

- д) метод сценариев
- е) имитационное моделирование

12. Субъект управления в риск-менеджменте это:

- а) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками
- б) все варианты верны
- в) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами

13. Объектом управления в риск-менеджменте выступает:

- а) риск, рискованные вложения капитала и экономические отношения между хозяйствующими субъектами
- б) все варианты верны
- в) специальная группа людей, которая посредством различных приемов и способов управленческого воздействия осуществляет управление рисками

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

- а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов
- б) закона неизбежности риска
- в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

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

- а) методы уклонения от рисков
- б) методы компенсации рисков
- в) методы диверсификации рисков
- г) методы локализации рисков

16. Дайте определение термину «риск»:

- а) разновидность ситуации, объективно содержащая высокую вероятность невозможности осуществления цели
- б) наличие факторов, при которых результаты действий не являются детерминированными, а степень возможного влияния этих факторов на результаты неизвестна
- в) следствие действия либо бездействия, в результате которого существует реальная возможность получения неопределенных результатов различного характера

17. Что из перечисленного относится к потерям времени?

- а) невыполнение сроков сдачи объекта
- б) потери ценных бумаг
- в) выплата штрафа
- г) уменьшение выручки вследствие снижения цен на реализуемую продукцию

д) уплата дополнительных налогов

18. Процесс использования механизмов уменьшения рисков называется так:

- а) диверсификация
- б) лимитирование
- в) хеджирование

19. Анализ риска подразумевает под собой следующее:

- а) систематизация множества рисков на основании каких-либо признаков и критериев, позволяющих объединить подмножества рисков в более общие понятия
- б) систематическое научное исследование степени риска, которому подвержены конкретные объекты, виды деятельности и проекты
- в) начальный этап системы мероприятий по управлению рисками, состоящий в систематическом выявлении рисков, характерных для определенного вида деятельности, и определении их характеристик

20. Выберите, что является принципом действия механизма диверсификации:

- а) избежание рисков
- б) разделение рисков
- в) снижение рисков

21. К этим методам относится распределение ответственности между участниками проекта:

- а) методы диверсификации рисков
- б) методы компенсации рисков
- в) методы локализации рисков
- г) методы уклонения от рисков

22. Выберите подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных техногенными катастрофами:

- а) антропогенные
- б) природно-климатические
- в) социально-бытовые

23. Отметьте подвид экологического риска, к которому можно отнести вероятность потерь, вызванных заболеваемостью животных и людей инфекционными заболеваниями:

- а) природно-климатические
- б) социально-бытовые
- в) антропогенные

24. Кривая риска представляет собой:

- а). Распределение вероятности потерь при заключении сделки
- б). Графическое изображение существующих рисков и вероятностей их наступления

25. Какие показатели оценки риска могут быть использованы в условиях определенности?

- а). Вероятностные и статистические показатели
- б). Абсолютные, относительные и средние показатели
- в). Экспертные оценки уровня риска

26. К каким методам относится прогнозирование внешней обстановки?

- а) методы компенсации рисков
- б) методы уклонения от рисков
- в) методы локализации рисков
- г) методы диверсификации рисков

27. К каким методам относится распределение риска по этапам работы?

- а) методы локализации рисков
- б) методы компенсации рисков
- в) методы уклонения от рисков
- г) методы диверсификации рисков

28. Выберите, к каким методам относится заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов:

- а) методы диверсификации рисков
- б) методы уклонения от рисков
- в) методы компенсации рисков
- г) методы локализации рисков

29. Название риска, который не зависит от состояния рынка и является спецификой конкретной организации:

- а) чистый
- б) спекулятивный
- в) несистемный
- г) системный

30. Коэффициент риска, шкалы риска и системы нормативов относятся к:

- а). Абсолютным показателям риска;
- б). Относительным показателям риска;
- в). Статистическим показателям риска.

31. Величина коэффициента риска в пределах от 0,3 до 0,6 характеризует:

- а). Минимальный уровень риска
- б). Допустимый уровень риска
- в). Высокий уровень риска
- г). Недопустимый уровень риска

32. Ситуация, когда информация о рисковом событии существует в виде частоты (вероятности) его появления, называется:

- а). Ситуацией определенности

- б). Ситуацией риска (частичной неопределенности)
- в). Ситуацией неопределенности

33. Статистический показатель оценки риска, характеризующий отклонение крайних значений результата от среднего, называется:

- а). Дисперсией
- б). Размахом вариации
- в). Средним квадратическим отклонением

34. Дисперсия как мера риска результата представляет собой:

- а). Отношение среднего квадратического отклонения к среднему ожидаемому значению, что характеризует количество риска на единицу доходности
- б). Средневзвешенную величину из квадратных отклонений действительных результатов от средних ожидаемых, что характеризует разброс результатов относительно среднего
- в). Средневзвешенное произведение всех возможных значений результатов на вероятности их возникновения

35. Показатель, выражающий количество риска на единицу доходности и являющийся комплексным относительным показателем, который позволяет сравнивать результаты, выраженные в разных единицах измерения, называется:

- а). Дисперсией
- б). Коэффициентом вариации
- в). Средним квадратическим отклонением

36. Недостатком статистических показателей оценки риска является:

- а). Большой объем исходных данных и необходимость учета дополнительных характеристик и критериев принятия решения
- б). Ограниченность применения
- в). Сложность расчетов

37. Экспертные методы принятия рискованных решений представляют собой:

- а). Качественные оценки специалистов, позволяющие наиболее полно описать ситуацию принятия рискованного решения и рассмотреть трудно формализуемые варианты
- б). Комплекс логических и математических процедур, направленных на получение от специалистов-экспертов информации, её анализ и обобщение с целью выбора рациональных решений

38. Оптимальным количеством экспертов при проведении экспертизы, если она не является анонимной и решение вырабатывается экспертами совместно, является:

- а). 2-3 человека
- б). 5-12 человек
- в). 15-20 человек

39. Проведение экспертизы в несколько туров, определение обобщенного мнения экспертов (медианы) и обоснование радикальных мнений отдельных специалистов характеризует:

- а). Метод группировок
- б). Метод ранжировок
- в). Метод Дельфи

40. Что такое идентификация риска?

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

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

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

41. Под максимальным объемом страховой защиты предприятия по конкретным видам страхуемых финансовых рисков понимается:

- а) страховой тариф
- б) страховая сумма
- в) страховая премия

42. Как называются риски, которые могут нести в себе как потери, так и дополнительную прибыль?

- а) чистыми
- б) критическими
- в) спекулятивными

43. На какие виды подразделяются риски по уровню финансовых потерь?

- а) допустимый, критический и катастрофический;
- б) недопустимый, допустимый и критический;
- в) критический, катастрофический и недопустимый.

44. Что такое последствия риска?

- а) скорее положительными
- б) как положительными, так и отрицательными
- в) только отрицательными

45. Как называются риски, которые практически всегда несут в себе потери?

- а) критическими
- б) спекулятивными
- в) чистыми

46. В основе какой из ниже предложенных операции лежит обмен финансовыми активами или обязательствами для улучшения их структуры

и снижения возможных потерь:

- а) своп
- б) хеджирование
- в) репо

47. Как называются риски, которые обусловлены деятельностью самого предприятия и его контактной аудиторией?

- а) внешними
- б) внутренними
- в) чистыми

48. Как называются риски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря прибыли?

- а) катастрофическими
- б) критическими
- в) допустимыми

49. Чем измеряется величина или степень риска?

- а) средним ожидаемым значение
- б) изменчивостью возможного результата
- в) оба варианта верны

50. В чем состоит социально-экономическая функция риска?

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

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

- в) оба варианта верны

51. Каким образом можно учитывать риск при расчете чистой приведенной стоимости?

а) в знаменателе формулы NPV посредством корректировки ставки дисконта

б) комбинация формул NPV посредством корректировки чистых денежных потоков

- в) все варианты верны

г) в числителе формулы NPV посредством корректировки чистых денежных потоков

52. Субъект управления в риск-менеджменте:

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

- б) все варианты верны

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

53. Объект управления в риск-менеджменте:

- а) риск, рисковые вложения капитала и экономические отношения между

хозяйствующими субъектами

б) все варианты верны

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

54. «Деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» включает в себя смысл:

а) закона неизбежности риска

б) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

в) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

55. «Практически в любых ситуациях риска потенциальная возможность потерь или убытков сочетается с потенциальной возможностью получения дополнительных доходов» включает в себя смысл:

а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

б) закона неизбежности риска

в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

56. «Чем выше степень риска при осуществлении хозяйственной операции, тем выше уровень планируемых от этой операции доходов» включает в себя смысл:

а) закона прямой зависимости между степенью риска и уровнем планируемых доходов

б) закона неизбежности риска

в) закона сочетания потенциальных потерь и выгод

57. Прогнозирование внешней обстановки относится к:

а) методы компенсации рисков

б) методы уклонения от рисков

в) методы локализации рисков

г) методы диверсификации рисков

58. Распределение риска по этапам работы относится к:

а) методы локализации рисков

б) методы компенсации рисков

в) методы уклонения от рисков

г) методы диверсификации рисков

59. Заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов относится к:

а) методы диверсификации рисков

б) методы уклонения от рисков

в) методы компенсации рисков

г) методы локализации рисков

60. Обучение и инструктирование персонала относится к:

а) методы уклонения от рисков

- б) методы компенсации рисков
- в) методы диверсификации рисков
- г) методы локализации рисков

Вопросы для подготовки к тестовым заданиям

1. Риск: сущность риска, событие риска, последствия риска.
2. Условия риска как объективные условия деятельности и развития организации.
3. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
4. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.
5. Концепция конфликта целей в организации.
6. Неопределенность, ее роль в развитии организации.
7. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.
8. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска.
9. Существенные признаки рисков. Влияние риска на эффективность управления.
10. Управление рисками и регулирование рисков.
11. Управленческое решение как объект управления рисками.
12. Управление рисками на индивидуальном уровне: основные характеристики объекта управления.
13. Организация как объект управления рисками.
14. Экономическая автономность, рискозащищенность. Модели экономической рискозащищенности.
15. Классификация факторов риска по степени непосредственного воздействия на эффективность управления.
16. Структурные и процессуальные факторы риска: проблемы идентификации и оценки.
17. Использовать метод избегания рисков.
18. Использовать метод принятия рисков на себя.
19. Использовать метод предотвращения убытков.
20. Использовать метод уменьшения размера убытков.
21. Использовать метод страхования.
22. Использовать метод самострахования.
23. Использовать метод передачи рисков.
24. Использовать принципы использования и комбинирования методов управления рисками.
25. Использовать методологические принципы оценки рисков.
26. Использовать методические и операционные принципы оценки рисков.
27. Использовать количественные методы оценки рисков.
28. Использовать качественные методы оценки рисков.
29. Использовать моделирование в управлении рисками.
30. Проводить уточнение стратегии организации при разработке программы управления рисками.
31. Проводить предварительный отбор рисков при разработке программы управления рисками.
32. Разработка плана превентивных мероприятий программы управления рисками.