

Частное образовательное учреждение высшего образования
«САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТЕХНОЛОГИЙ
УПРАВЛЕНИЯ И ЭКОНОМИКИ»

РАССМОТРЕНО И ОДОБРЕНО

УТВЕРЖДАЮ

На заседании кафедры экономики и
управления социально-
экономическими системами
Протокол № 10 от 25.05.2023 г.

Первый проректор
С.В. Авдашкевич
28.06.2023

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина:	Б1.В.ДВ.03.01 Управление рисками в цепях поставок
Направление подготовки:	38.03.02 Менеджмент
Направленность (профиль):	Логистический менеджмент
Уровень высшего образования:	Бакалавриат
Форма обучения:	очная, заочная, очно-заочная
Разработчики:	Кандидат экономических наук, доцент Амельченко Е.Н.

Санкт-Петербург
2023

1. Цели и задачи дисциплины:*Цель освоения дисциплины:*

- освоение студентами теоретических знаний в области моделирования экономических процессов в условиях риска; - приобретение навыков принятия управленческих решений в ситуациях связанных с риском, способность проводить анализ рисков и использовать его результаты для принятия управленческих решений.

Задачи дисциплины:

-изучение сущности понятия риска в целом и экономического риска, в частности, классификацию рисков, методы оценки и прогнозирования рисков;

- понятие системы управления рисками (риск-менеджмент);

- иметь представление о формировании рисков, их оценке, а также уметь управлять рисками проекта.

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы высшего образования

Планируемые результаты освоения ОП ВО (код и содержание компетенций)	Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Примечание
ПК-3 Способен организовывать процесс улучшения качества оказания логистических услуг по перевозке грузов в цепи поставок	ПК-3.1 Знает правовые основы транспортно-логистической деятельности; основы гражданского законодательства; коммерческую политику компании; политику компании в области клиентского сервиса; корпоративную структуру компании.	40.049 Профессиональный стандарт «Специалист по логистике на транспорте»
	ПК-3.2 Умеет устанавливать требования клиентов к результату перевозки и ранжировать их по степени значимости для клиентов; профессионально работать с претензионной документацией; оформлять документы на несоответствующую услугу; проводить переговоры с клиентами из различных отраслей экономики; анализировать информацию и формировать отчеты.	
	ПК-3.3 Способен выполнять следующие трудовые действия: проводить переговоры с клиентами по претензионным случаям; определять причастных и виновных лиц; определять причины, повлекшие предъявление претензии; взаимодействовать с клиентами по качеству сервиса; организовывать мониторинг эффективности контрагентов, переадресовывать им претензии клиента в случае некачественного сервиса со стороны контрагента; составлять реестр наиболее часто задаваемых клиентами вопросов; разрабатывать инструкции по предотвращению претензий.	

Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-3.1. Знает правовые основы транспортно-логистической деятельности; основы гражданского законодательства; коммерческую политику компании; политику компании в области клиентского сервиса; корпоративную структуру компании.	-сущность рисков в логистической системе - источники рисков - причины и факторы возникновения с учетом специфики функциональных областей логистики - организацию и управление логистическим рисками - принципы построения системы управления рисками -стратегии и приемы управления -методы управления рисками в логистической системе

Планируемые результаты обучения по ОП ВО (индикаторы достижения компетенций)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-3.2. Умеет устанавливать требования клиентов к результату перевозки и ранжировать их по степени значимости для клиентов; профессионально работать с претензионной документацией; оформлять документы на несоответствующую услугу; проводить переговоры с клиентами из различных отраслей экономики; анализировать информацию и формировать отчеты.	-самостоятельно классифицировать риски по различным признакам, -осуществлять сравнение альтернативных решений в условиях риска - самостоятельно участвовать в управлении логистическими рисками; - самостоятельно разрабатывать программу по управлению логистическими рисками
ПК-3.3. Способен выполнять следующие трудовые действия: проводить переговоры с клиентами по претензионным случаям; определять причастных и виновных лиц; определять причины, повлекшие предъявление претензии; взаимодействовать с клиентами по качеству сервиса; организовывать мониторинг эффективности контрагентов, переадресовывать им претензии клиента в случае некачественного сервиса со стороны контрагента; составлять реестр наиболее часто задаваемых клиентами вопросов; разрабатывать инструкции по предотвращению претензий.	-навыками распознавания логистических рисков в цепях поставок и методикой оценки потерь ресурсов - основными методами управления рисками, -навыками решения практических задач в области риск-менеджмента

3. Содержание, объем дисциплины и формы проведения занятий

№ п/п	Наименование темы дисциплины	Компетенции	Оценочные средства текущего контроля		
			ЗНАТЬ	УМЕТЬ	ВЛАДЕТЬ
			ПК-3.1	ПК-3.2	ПК-3.3
1	Введение. Риск в деятельности предприятий.	ПК-3	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Круглый стол, дискуссия, полемика, дебаты/Эссе №1 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
2	Методы определения вероятности и последствий рисков.	ПК-3	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Круглый стол, дискуссия, полемика, дебаты/Эссе №1 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1 (20)
3	Принятие решений в условиях риска и неопределенности	ПК-3	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Круглый стол, дискуссия, полемика, дебаты/Эссе №1 (20)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №2 (20)
4	Методы снижения воздействия финансовых рисков на предприятие.	ПК-3	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Задача №1 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №2 (20)
5	Оценка и анализ инвестиционных рисков	ПК-3	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Задача №1 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №3 (20)
6	Риск банкротства.	ПК-3	Доклад, сообщение/ Реферат №1 (10)	Задача №1 (10)	Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №3 (20)
Количество баллов (100 баллов):			100		

Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа
Тема 1: Введение. Риск в деятельности предприятий.

Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа
<p>Место и роль рисков в экономической деятельности предпринимателя. Понятие риска как экономической категории. Причины и источники возникновения предпринимательских рисков. Неопределенность и риск, их свойства и отличительные особенности. Сущность риска. Функции риска в экономике. Историческое развитие взглядов ведущих экономистов на понятие риска и его роль в экономике. Основные научные концепции риска. Взаимосвязь максимизации прибыли, новаторства, неопределенности и риска. Отношение к риску классической, экономических школ. Современные классификации рисков, их основные проявления. Виды рисков, как основной классификационный признак. Инфляционный риск, "бизнес-риск", налоговый риск, инвестиционный риск, инновационный риск, риск потери финансовой устойчивости, возможности избежания рисков для хозяйствующего субъекта. Иные классификационные признаки. Проблемы риска в экономике России.</p> <p>Практические занятия/самостоятельная работа: Место риска в инвестировании капитала.</p> <p>Лабораторная работа: -</p>
<p>Тема 2: Методы определения вероятности и последствий рисков. Сущность статистических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия. Статистические методы, определяющие степень риска предприятия с помощью вероятности наступления событий. Риск как мера неопределенности ожидаемого дохода. Риск как мера колеблемости дохода. Математико-статистические показатели риска в терминах распределения вероятностей ожидаемого дохода и среднеквадратического отклонения от среднеожидаемого дохода. Вариация, ковариация, корреляция. Среднеквадратическое отклонение от среднего наблюдавшегося дохода. Уменьшение этих показателей как цель и содержание управления рисками. Положительные и отрицательные стороны статистических методов.</p> <p>Практические занятия/самостоятельная работа: Способы оценки степени риска.</p> <p>Лабораторная работа: -</p>
<p>Тема 3: Принятие решений в условиях риска и неопределенности Понятие неопределенности финансовой среды. Отличие неопределенности от риска. Понятие "лица принимающие решения" (ЛПР). Основные психологические портреты ЛПР и модели поведения. Принятие оптимальных решений в условиях полной и частичной неопределенности. Критерий Вальда. Оптимистичный критерий. Нейтральный критерий. Критерий Сэвиджа. Утопическая точка. Критерий Гурвица. Критерий произведений. Критерий Гермейера. Выбор на основе идеальной точки. Модификация критериев.</p> <p>Практические занятия/самостоятельная работа: Принятие оптимальных решений в условиях полной и частичной неопределенности.</p> <p>Лабораторная работа: -</p>
<p>Тема 4: Методы снижения воздействия финансовых рисков на предприятие. Основные возможности и последствия управления рисками для предприятия. Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков. Избежание рисков. Лимитирование концентрации уровня риска. Хеджирование. Диверсификация. Трансферт рисков. Самострахование. Факторинг. Страхование как метод управления предпринимательскими рисками. Перестрахование и сфера его применения. Преимущества и недостатки страхования. Доверительное страхование.</p> <p>Практические занятия/самостоятельная работа: Актуарные расчеты в страховании.</p> <p>Лабораторная работа: -</p>
<p>Тема 5: Оценка и анализ инвестиционных рисков Понятие инвестиционного риска. Проектные и инновационные риски. Теория распределения потоков платежей во времени. Критерии оценки экономической эффективности инвестиционных проектов. Методы учета неопределенности и оценки рисков инвестиционных проектов. Понятие "дисконтирования" и "компаундирования". Сущность дисконтирования для собственного капитала инвестиционного проекта и ее взаимосвязь с уровнем риска проекта. Формирование ставки дисконта. Формализованные и неформализованные методы, используемые при принятии решений инвестиционного характера. "Простые" (PP, ARR, CC и пр.) и "сложные" (NPV, IRR, PI и пр.) методы оценки эффективности инвестиций. Модель оценки капитальных активов (CAPM), учитывающая риски инвестиционных проектов. Методы оценки безрисковой ставки доходности с учетом влияния странового риска, роль государственных облигаций.</p> <p>Практические занятия/самостоятельная работа: Критерии оценки экономической эффективности инвестиционных проектов.</p> <p>Лабораторная работа: -</p>
<p>Тема 6: Риск банкротства.</p>

38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль) "Логистический менеджмент"

Рабочая программа дисциплины

Дисциплина: Б1.В.ДВ.03.01 Управление рисками в цепях поставок

Форма обучения: очная, заочная, очно-заочная

Разработана для приема 2023/2024 учебного года

Содержание учебного материала, лабораторные работы и практические занятия, курсовая работа
Риск банкротства как основное проявление финансовых рисков предприятия. Действующее законодательство Российской Федерации о банкротстве предприятия. Комплексная оценка финансового состояния предприятия, превентивные меры борьбы с банкротством. Методы диагностики банкротства. Трендовый анализ. Индексы и модели. Бивер, Альтман, Лист, Фулмер, Фридман, Гордон, Таффлер и пр. Платежеспособность и ликвидность предприятия в оценке риска банкротства предприятия. Антикризисная политика и антикризисное управление предприятием. Реорганизация и ликвидация предприятия.
Практические занятия/самостоятельная работа: Платежеспособность и ликвидность предприятия в оценке риска банкротства предприятия.
Лабораторная работа: -
Курсовая работа: не предусмотрено учебным планом

Очная форма обучения

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 7
Аудиторные занятия (АЗ):	54	54
Лекционные занятия (Лек)	18	18
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	36	36
Самостоятельная работа студента (СР)	49	49
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	49	49
Контроль самостоятельной работы (КСР)	5	5
Контактная работа (КоР)	59	59
Форма промежуточной аттестации	0	Зачет
Подготовка к экзамену и сдача экзамена (СР, КоР)	0	0
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	108/3	108/3

* Подготовка к аудиторным занятиям, подготовка к зачету (при наличии)

№	Наименование темы дисциплины	Семестр/ Курс	Количество учебных часов				Практическая подготовка
			В том числе по видам аудиторных занятий			СР	
			Лек	Пр	Лаб		
1	Введение. Риск в деятельности предприятий.	7	2	6	0	8	6
2	Методы определения вероятности и последствий рисков.	7	2	6	0	8	6
3	Принятие решений в условиях риска и неопределенности	7	2	6	0	8	6
4	Методы снижения воздействия финансовых рисков на предприятие.	7	4	6	0	8	6
5	Оценка и анализ инвестиционных рисков	7	4	6	0	8	6
6	Риск банкротства.	7	4	6	0	9	6
Итого:			18	36	0	49	36

* Практическая подготовка при реализации дисциплин организована путем проведения практических занятий и (или) выполнения лабораторных и (или) курсовых работ и предусматривает выполнение работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

Заочная форма обучения

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 8
Аудиторные занятия (АЗ):	10	10
Лекционные занятия (Лек)	4	4
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	6	6
Самостоятельная работа студента (СР)	89	89
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	89	89
Контроль самостоятельной работы (КСР)	5	5
Контактная работа (КоР)	15	15

38.03.02 Менеджмент, направленность (профиль) "Логистический менеджмент"

Рабочая программа дисциплины

Дисциплина: Б1.В.ДВ.03.01 Управление рисками в цепях поставок

Форма обучения: очная, заочная, очно-заочная

Разработана для приема 2023/2024 учебного года

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 8
Форма промежуточной аттестации	0	Зачет
Подготовка к экзамену/зачету и сдача экзамена/зачета (СР, КоР)	4	4
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	108/3	108/3

* Подготовка к аудиторным занятиям

№	Наименование темы дисциплины	Семестр/ Курс	Количество учебных часов				Практическая подготовка
			В том числе по видам аудиторных занятий			СР	
			Лек	Пр	Лаб		
1	Введение. Риск в деятельности предприятий.	8	2	2	0	12	6
2	Методы определения вероятности и последствий рисков.	8	0	0	0	16	6
3	Принятие решений в условиях риска и неопределенности	8	0	0	0	16	6
4	Методы снижения воздействия финансовых рисков на предприятие.	8	2	2	0	16	6
5	Оценка и анализ инвестиционных рисков	8	0	2	0	16	6
6	Риск банкротства.	8	0	0	0	13	6
Итого:			4	6	0	89	36

* Практическая подготовка при реализации дисциплин организована путем проведения практических занятий и (или) выполнения лабораторных и (или) курсовых работ и (или) путем выделения часов из часов, отведенных на самостоятельную работу, и предусматривает выполнение работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

Очно-заочная форма обучения

Вид учебной работы	Всего часов	Семестр 8
Аудиторные занятия (АЗ):	36	36
Лекционные занятия (Лек)	18	18
Лабораторные занятия (Лаб)	0	0
Практические занятия (Пр)	18	18
Самостоятельная работа студента (СР)	69	69
Курсовая работа	0	0
Другие виды самостоятельной работы*	69	69
Контроль самостоятельной работы (КСР)	3	3
Контактная работа (КоР)	39	39
Форма промежуточной аттестации	0	Зачет
Подготовка к экзамену и сдача экзамена (СР, КоР)	0	0
Общая трудоемкость дисциплины, часы/ЗЕТ	108/3	108/3

* Подготовка к аудиторным занятиям, подготовка к зачету (при наличии)

№	Наименование темы дисциплины	Семестр/ Курс	Количество учебных часов				Практическая подготовка
			В том числе по видам аудиторных занятий			СР	
			Лек	Пр	Лаб		
1	Введение. Риск в деятельности предприятий.	8	4	4	0	12	6
2	Методы определения вероятности и последствий рисков.	8	2	2	0	12	6
3	Принятие решений в условиях риска и неопределенности	8	2	2	0	12	6
4	Методы снижения воздействия финансовых рисков на предприятие.	8	4	4	0	12	6
5	Оценка и анализ инвестиционных рисков	8	4	4	0	12	6
6	Риск банкротства.	8	2	2	0	9	6
Итого:			18	18	0	69	36

* Практическая подготовка при реализации дисциплин организована путем проведения практических занятий и (или) выполнения лабораторных и (или) курсовых работ и (или) путем выделения часов из часов, отведенных на самостоятельную работу, и предусматривает выполнение работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

4. Способ реализации дисциплины

Без использования онлайн-курса.

5. Учебно-методическое обеспечение дисциплины:

Основная литература:

1. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ 2-е изд. Учебник и практикум для вузов / Воронцовский А. В. - Санкт-Петербургский государственный университет (г. Санкт-Петербург)., 2023 г. - 485 с. - ISBN 978-5-534-12206-0 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-riskami-511534>

2. УПРАВЛЕНИЕ ЦЕПЯМИ ПОСТАВОК. Учебник для вузов / Сергеев В. И. - Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики» (г. Москва)., 2023 г. - 480 с. - ISBN 978-5-534-01356-6 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-cepuyami-postavok-510980>

3. УПРАВЛЕНИЕ ЦЕПЯМИ ПОСТАВОК. Учебник для вузов / Под ред. Щербакова В. В. - Санкт-Петербургский государственный экономический университет (г. Санкт-Петербург)., 2023 г. - 209 с. - ISBN 978-5-534-00689-6 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/upravlenie-cepuyami-postavok-513482>

Дополнительная литература:

1. ЛОГИСТИКА И УПРАВЛЕНИЕ ЦЕПЯМИ ПОСТАВОК. Учебник и практикум для вузов / Лукинский В. С., Лукинский В. В., Плетнева Н. Г. - Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики» (г. Москва)., 2023 г. - 359 с. - ISBN 978-5-534-00208-9 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/logistika-i-upravlenie-cepuyami-postavok-511010>

2. ЛОГИСТИКА И УПРАВЛЕНИЕ ЦЕПЯМИ ПОСТАВОК НА ТРАНСПОРТЕ. Учебник для вузов / Под ред. Карапетянц И. В., Павловой Е. И. - Российский университет транспорта (МИИТ) (г. Москва)., 2023 г. - 362 с. - ISBN 978-5-534-14951-7 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/logistika-i-upravlenie-cepuyami-postavok-na-transporte-520326>

3. ЛОГИСТИКА И УПРАВЛЕНИЕ ЦЕПЯМИ ПОСТАВОК. Учебник для вузов / Под ред. Щербакова В. В. - Санкт-Петербургский государственный экономический университет (г. Санкт-Петербург)., 2023 г. - 582 с. - ISBN 978-5-534-11711-0 – Режим доступа: <https://urait.ru/book/logistika-i-upravlenie-cepuyami-postavok-510565>

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

1. Операционная система
2. Пакет прикладных офисных программ
3. Антивирусное программное обеспечение
4. LMS Moodle
5. Вебинарная платформа

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», информационных справочных систем и профессиональных баз данных, необходимых для освоения дисциплины

1. ibooks.ru : электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: <https://ibooks.ru>. - Текст: электронный

2. Электронно-библиотечная система СПБУТУиЭ : электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: <http://libume.ru>. - Текст: электронный

3. Юрайт : электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : профессиональная

база данных. - Режим доступа: <https://urait.ru>. - Текст: электронный

4. eLibrary.ru : научная электронная библиотека [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: <http://elibrary.ru>. - Текст: электронный

5. Архив научных журналов НЭИКОН [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: arhiv.neicon.ru. - Текст: электронный

6. КиберЛенинка : научная электронная библиотека [Электронный ресурс] : информационная справочная система. - Режим доступа: <http://cyberleninka.ru>. - Текст: электронный

7. Лань : электронно-библиотечная система [Электронный ресурс] : профессиональная база данных. - Режим доступа: <https://e.lanbook.com>. - Текст: электронный

8. Управление производством [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <http://www.up-rpo.ru>. - Текст: электронный

9. it-world.ru [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <https://www.it-world.ru>. - Текст: электронный

10. Корпоративный менеджмент [Электронный ресурс] : информационная справочная система . - Режим доступа: <https://www.cfin.ru>. - Текст: электронный

11. Министерство транспорта Российской Федерации: профессиональная база данных . - Режим доступа: <http://www.mintrans.ru>. - Текст: электронный

12. Экономика. Социология. Менеджмент: федеральный образовательный портал: профессиональная база данных. - Режим доступа: <http://ecsocman.hse.ru/>. - Текст: электронный

13. Executive.ru: профессиональная база данных . - Режим доступа: <https://www.executive.ru>. - Текст: электронный

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

1. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа - практических занятий, для групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оборудованная: рабочими местами для обучающихся, оснащенными специальной мебелью; рабочим местом преподавателя, оснащенным специальной мебелью, персональным компьютером с возможностью подключения к сети «Интернет» и доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета; техническими средствами обучения - мультимедийным оборудованием (проектор, экран, колонки) и маркерной доской; лицензионным программным обеспечением

2. Помещение для самостоятельной работы, оборудованное специальной мебелью, персональными компьютерами с возможностью подключения к сети «Интернет» и доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета, лицензионным программным обеспечением

3. При применении электронного обучения, дистанционных образовательных технологий используются: виртуальные аналоги учебных аудиторий - вебинарные комнаты на вебинарных платформах, рабочее место преподавателя, оснащенное персональным компьютером (планшет, мобильное устройство) с возможностью подключения к сети «Интернет», доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета и к информационно-образовательному portalу Университета imeos.ru, веб-камерой, микрофоном и гарнитурой (в т.ч. интегрированными в устройства), программным обеспечением; рабочее место обучающегося оснащено персональным компьютером (планшет, мобильное устройство) с возможностью подключения к сети «Интернет», доступом к электронной информационно-образовательной среде Университета и к информационно-образовательному portalу Университета imeos.ru, веб-камерой, микрофоном и гарнитурой (в т.ч. интегрированными в устройства). Авторизация на информационно-образовательном portalе Университета imeos.ru и начало работы осуществляются с использованием персональной учетной записи (логина и пароля). Лицензионное программное обеспечение

9. Оценочные материалы по дисциплине

Описание оценочных средств (показатели и критерии оценивания, шкалы оценивания) представлено в приложении к основной профессиональной образовательной программе «Каталог оценочных средств текущего контроля и промежуточной аттестации».

Процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности приводятся в соответствующих методических материалах и локальных нормативных актах Университета.

Для оценивания учебных достижений студентов в Университете действует балльно-рейтинговая система.

Если оценка, соответствующая набранной в семестре сумме рейтинговых баллов, удовлетворяет студента, то она является итоговой оценкой по дисциплине при проведении промежуточной аттестации в форме экзамена/зачета с оценкой/зачета.

Условием сдачи экзамена/зачета с оценкой/зачета с целью повышения итоговой оценки по дисциплине является сдача студентом экзамена, за который он получает экзаменационные баллы без учета баллов, полученных за текущий контроль:

Шкала оценивания учебных достижений по дисциплине, завершающейся зачетом без оценки

Баллы по дисциплине	60 и менее		61-73		74-90		91-100
Итоговая оценка по дисциплине	Незачет		Зачет				
Баллы в международной шкале ECTS с буквенным обозначением уровня	50 и менее	51-60	61-67	68-73	74-83	84-90	91-100
	F	Fx	E	D	C	B	A
Уровень сформированности компетенций	Не сформированы		Пороговый		Высокий		Повышенный

Шкала оценивания учебных достижений по дисциплине, завершающейся экзаменом/зачетом с оценкой

Баллы по дисциплине	60 и менее		61-73		74-90		91-100
Итоговая оценка по дисциплине	Неудовлетворительно		Удовлетворительно		Хорошо		Отлично
Баллы в международной шкале ECTS с буквенным обозначением уровня	<50	51-60	61-67	68-73	74-83	84-90	91-100
	F	Fx	E	D	C	B	A
Уровень сформированности компетенций	Не сформированы		Пороговый		Высокий		Повышенный

9.1. Типовые контрольные задания для текущего контроля

Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №1

Задание 1.1

Люди оказываются в состоянии беспокойства, когда у них появляются желания, которые пока не могут быть удовлетворены имеющимися возможностями. Они ощущают побуждение к действию, но одновременно – и препятствие, мешающее его исполнению. Как следствие, люди испытывают дискомфорт, неуверенность, им постоянно кажется, что что-то не так. Это внутреннее напряжение часто проявляется в суетливости, не скоординированной деятельности.

Точно так же и в приложении к проблемам ведения хозяйственной, экономической деятельности в России в последние годы. И эти проявления беспокойства можно объяснить достаточно определенно: время, когда сравнительно легко и быстро можно было сделать большие деньги, минуло. На рынке товаров и услуг постепенно становится тесно. И теперь уже приходится бороться за каждый процент прибыли.

Вопросы

1. Существует ли связь между внутренним напряжением, возникающим у человека в состоянии

беспокойства, и его поступками?

2. Какие виды рисков преобладали в российской экономике в 1990-е гг.?

3. Какие риски преобладают в российской экономике сегодня и как они влияют на ведение предпринимательской деятельности?

Задание 1.2

Перечень качеств, которыми должен обладать современный руководитель:

1 Компетентность в избранной сфере бизнеса.

2 Способность эффективно действовать в условиях рынка, детально знать менеджмент, маркетинг, уметь обеспечивать при любых рыночных ситуациях оптимальные хозяйственные результаты.

3 Способность организовывать, координировать, направлять и контролировать деятельность подчиненных.

4 Высокие нравственные качества: честность, правдивость, скромность, высокая требовательность к себе и к другим, развитые чувства долга и ответственности.

5 Единство слова и дела, оперативность и гибкость в работе, умение самостоятельно и своевременно принимать оптимальное решение, добиваться исполнения его подчиненными.

6 Глубокое знание человеческой психологии, способов налаживания контактов с людьми, умение формировать коллектив с высоким творческим потенциалом.

7 Стремление к наиболее рациональному распределению функций между собой и сотрудниками, объективная оценка результатов деятельности и своей, и сотрудников.

8 Справедливость во взаимоотношениях с подчиненными, умение завоевывать их доверие, создавать в коллективе благоприятный психологический климат.

9 Умение стратегически мыслить, предугадывать тенденции развития рынка, организовывать свою работу и работу сотрудников с учетом перспективы.

10 Постоянное обновление собственных знаний, поддержание их в соответствии с растущими потребностями общества.

11 Забота о здоровье, работоспособности и повседневных нуждах работников.

Вопросы

1. Согласны ли Вы с представленным перечнем качеств, которыми должен обладать менеджер?

2. Какие риски, на Ваш взгляд, снижает каждое из вышеперечисленных качеств?

3. Имеются ли какие-либо специфические требования к риск-менеджеру?

Доклад, сообщение/Реферат №1

1. Сущность статистических методов и моделей определения и оценки рисков предприятия.

2. Статистические методы, определяющие степень риска предприятия с помощью вероятности наступления событий.

3. Риск как мера неопределенности ожидаемого дохода.

4. Риск как мера колеблемости дохода.

5. Математико-статистические показатели риска в терминах распределения вероятностей ожидаемого дохода и среднеквадратического отклонения от среднеожидаемого дохода.

6. Вариация, ковариация, корреляция.

7. Среднеквадратическое отклонение от среднего наблюдавшегося дохода.

8. Уменьшение этих показателей как цель и содержание управления рисками.

Круглый стол, дискуссия, полемика, дебаты/Эссе №1

1. Понятие неопределенности финансовой среды.
2. Отличие неопределенности от риска.
3. Основные психологические портреты ЛПП и модели поведения.
4. Принятие оптимальных решений в условиях полной и частичной неопределенности.
5. Критерий Вальда.
6. Оптимистичный критерий.
7. Нейтральный критерий.
8. Критерий Сэвиджа.
9. Утопическая точка.
10. Критерий Гурвица.
11. Критерий произведений.
12. Критерий Гермейера.
13. Выбор на основе идеальной точки.
14. Модификация критериев.

Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №2

1. Стоимость застрахованного оборудования составляет 14 000 д.е., страховая сумма —10 000 д.е., ущерб страхователя при наступлении страхового случая —8500 д.е.
Определите страховое возмещение по системе пропорциональной ответственности и по системе первого риска.
2. Инвентарь застрахован по системе пропорциональной ответственности на сумму 8425 д.е. Оценка —9000 д.е. При какой сумме ущерба страховое возмещение будет равно 7425 д.е.?
3. Рассчитайте страховой ущерб при полной гибели сельскохозяйственного урожая, если средняя стоимость застрахованного урожая с 1 га —800 тыс. д.е, общая площадь посева —5 га.
4. При пожаре сгорело оборудование предприятия.
Исчислить страховое возмещение, если балансовая стоимость оборудования —24 000 д.е. Имущество застраховано на 90% балансовой стоимости.
5. Определите ущерб при гибели сельскохозяйственного урожая на всей площади посева, если средняя стоимость застрахованного урожая с 1 га — 25 500 д.е., общая площадь посева —200 га.
6. В результате дорожно-транспортного происшествия уничтожен автомобиль. Цена автомобиля —24 000 д.е. Износ на день заключения договора —30%.
От автомобиля остались детали на сумму 7000 д.е. На приведение в порядок указанных деталей израсходовано 2000 д.е.
Определите ущерб страхователя, если автомобиль застрахован в полной стоимости.
7. Заключен договор кредитного страхования.
Сумма непогашенного в срок кредита составляет 244 тыс. д.е.
Предел ответственности страховщика —85%.
Рассчитайте страховое возмещение.

Деловая и (или) ролевая игра/Кейс-задача №3

1. Определить реальную будущую стоимость инвестируемых денежных средств, если объем инвестиций - 100 тыс. рублей, период инвестирования - 3 года; номинальная ставка процента (с учетом инфляции) - 20 % в год; ожидаемый темп инфляции в год - 10 %.
2. Компания планирует приобрести новое оборудование по цене 36000 тыс. рублей, которое обеспечивает 20 000 тыс. рублей экономии затрат в год в течение ближайших трех лет. За этот период оборудование подвергнется полному износу. Стоимость капитала компании составляет 16%, и ожидается инфляция 10% в год. Необходимо определить эффективность данного инвестиционного проекта без учета и с учетом инфляции.

3. В уплату за песок и гравийную массу, компания выписывает вексель, который должен быть оплачен через 1 год и сумма погашения по которому составляет 850 тыс. рублей. Стоимость песка и гравийной массы составляет 680 тыс. рублей. Прогнозируемый уровень инфляции 20 % годовых. Определить ожидаемую реальную доходность держателя векселя.

4. Компания оказала заказчику услуги по перевозкам грузов. Заказчик выписал транспортной компании вексель на сумму 407 тыс. рублей. с погашением через 6 месяцев. Стоимость услуг составила 370 тыс. рублей. Прогнозируемый на ближайшие полгода уровень инфляции составляет 6 %. Определить реальную доходность по векселю за полгода.

5. Рассчитайте NPV проекта, используя реальную и номинальную ставку дисконтирования. Капитальные вложения в проект 240 тыс. руб., ежегодные чистые денежные поступления одинаковы: 192 тыс. руб. в течение трех лет. Номинальная ставка дисконтирования – 28%, среднегодовой темп инфляции – 13%.

6. Рассчитайте чувствительность инвестиционного проекта с помощью коэффициента эластичности по чистому дисконтированному доходу и факторам, влияющим на него. Проранжируйте их по следующим данным:

Переменный фактор	Изменение фактора, %	Базовое значение NPV	Измененное значение NPV	Изменение NPV, %	Эластичность	Рейтинг
Цена	20	5800	4800			
Объем производства	20	5800	5300			
Налог на прибыль	20	5800	5700			
Объем продаж	20	5800	4950			

7. Определите точку безубыточности, показатель финансовой прочности и дайте экономическую интерпретацию полученным результатам, если известны следующие данные: объем продаж – 2 500 млн руб., издержки переменные – 800 млн руб., издержки постоянные – 350 млн руб.

8. Рассчитать точку безубыточности по проекту в целом и по каждой продукции, по следующим данным:

Показатель	1	2	3	Итого
Объем продаж, тыс. рублей	250	300	450	
Издержки переменные, тыс. рублей	30	120	360	
Издержки постоянные, тыс. рублей	50	60	90	

9. Для базового варианта чистый приведенный доход инвестиционного проекта равен 3 456 тыс. руб., при цене реализации единицы продукции по 150 руб. за шт. При уменьшении цены единицы продукции на 3 руб. чистый приведенный доход составит 3 388 тыс. руб. Определить эластичность чистого приведенного дохода по цене реализации.

Задача №1

1. Величина текущих обязательств предприятия (сумма итогов второго и третьего разделов баланса) на конец отчетного периода – 2350 тыс. руб., текущие обязательства – 1680 тыс. руб. Каким должна быть прибыль предприятия в следующие шесть месяцев, чтобы достигнуть нормативного значения коэффициента покрытия, равного двум, при условии, что сумма текущих обязательств не вырастет?

2. Определите сумму собственного капитала фирмы, если известно что сумма внеоборотных средств фирмы составляет – 1800553 тыс. руб., сумма долгосрочных обязательств – 108826 тыс.

руб., краткосрочных обязательств – 1040136 тыс. руб., а сумма оборотных активов – 1015034 тыс. руб.

3. Имеются следующие данные: денежные средства – 70 тыс. руб.; краткосрочные финансовые вложения – 28 тыс. руб.; дебиторская задолженность – 130 тыс. руб.; основные средства – 265 тыс. руб.; нематериальные активы – 34 тыс. руб.; производственные запасы – 155 тыс. руб.; кредиторская задолженность – 106 тыс. руб., краткосрочные кредит банка – 95 тыс. руб.; долгосрочные кредиты – 180 тыс. руб. Определите коэффициент текущей ликвидности, коэффициент срочной ликвидности, коэффициент абсолютной ликвидности.

4. Активы предприятия составляют 115 млн. руб., выручка от продаж – 196 млн. руб., рентабельность продаж – 14,5%. Определите рентабельность активов.

5. Определите рентабельность активов и источников собственных средств фирмы, если прибыль за год составила 1800 тыс. рублей, а валюта баланса на начало года составляла 36090 тыс. рублей, в том числе собственный капитал фирмы 12070 тыс. рублей, на конец года валюта баланса составила 39800 тыс. рублей, в том числе собственный капитал фирмы 13100 тыс. руб.

6. Имеются следующие данные: денежные средства – 70 тыс. руб.; краткосрочные финансовые вложения – 28 тыс. руб.; дебиторская задолженность – 130 тыс. руб.; основные средства – 265 тыс. руб.; нематериальные активы – 34 тыс. руб.; производственные запасы – 155 тыс. руб.; кредиторская задолженность – 106 тыс. руб., краткосрочные кредит банка – 95 тыс. руб.; долгосрочные кредиты – 180 тыс. руб. Определите коэффициент текущей ликвидности, коэффициент срочной ликвидности, коэффициент абсолютной ликвидности.

7. Объем реализации продукции – 150 млн. Затраты на реализованную продукцию – 100 млн. Рентабельность продукции (по чистой прибыли) – 15% Рентабельность активов – 6% Рентабельность капитала – 12% Рассчитать период оборачиваемости авансированного и собственного капитала.

8. Составить отчет о прибылях и убытках компании, если известно, что фирма реализовала в отчетном периоде 250 тыс. единиц продукции по цене 10 долл. за единицу; затраты на выплату заработной платы и покупку материалов составили 1560 тыс. долл.; коммерческие и административные расходы составили 11 тыс. долл.; прочие расходы 7 тыс. долл.; ставка налога на прибыль 20 % от прибыли; амортизационный фонд за отчетный период составил 20 тыс. долл.; проценты за кредит в текущем периоде составили 40 тыс. долл. Кроме того, известно, что компания выпустила 2000 привилегированных акций номиналом 300 долл. и ставкой дивидендов 20 %.

9. Выручка от реализации 5 млн.руб. Соотношение выручки и собственных оборотных средств – 2:1 Соотношение внеоборотных и оборотных средств – 3:1 Коэффициент текущей ликвидности = 4 Определить: 1. величину текущих обязательств, 2. величину внеоборотных активов.

9.2. Примерный перечень тем курсовой работы

Не предусмотрено учебным планом

9.3. Типовые контрольные задания для промежуточной аттестации: зачет

Примерный перечень теоретических вопросов к зачету

1. Соотношение эффективности и риска в предпринимательской деятельности.
2. Инновационная предпринимательская деятельность и риск.
3. Из истории возникновения и развития предпринимательства как рискованной формы деятельности.
4. Предпринимательский риск и собственность.

5 Эволюция отношения к риску.

6. Роль риска в логистике

7. Риски, вызванные организационной структурой

8. Риск, обусловленный поведением конкурентов.

9. Риск неоптимального распределения ресурсов.

10. Специальные виды потерь в цепях поставок.

11. Возможность прогнозирования потерь от рисков.

12. Качественная оценка уровней потерь и выигрышей.

13. Расчетно-аналитический способ построения кривой риска.

14. Зоны риска в цепях поставок.

15. Рисковая функция страхования.

16. Риски логистических провайдеров

17. Оценка риска инвестиционного проекта

18. Стратегия и тактика в управлении логистическим риском.

19. Риск-менеджмент и практика.

20. Риск-менеджмент в сопровождении цепей поставок

21. Управление транспортными рисками.

22. Сферы возникновения вторичных рисков.

23. Хеджирование, как метод снижения степени рисков.

24. Рынок и развитие кооперации в элиминации рисков

25. Биржевой риск и развитие международных рыночных отношений.

26. Факторы, определяющие риск логистических проектов

27. Риск иностранного кредитования

28. Доступ к статистике, как фактор снижения риска

29. Влияние риска на развитие научно-технического прогресса области проектирования и сопровождения цепей поставок.

30. Влияние фактора риска на развитие законодательной системы.

31. Управляемый риск как инструмент воздействия на рыночную экономику.

Примерный перечень практических заданий к зачету

Задачи

Задача 1. Величина текущих обязательств предприятия (сумма итогов второго и третьего разделов баланса) на конец отчетного периода – 2350 тыс. руб., текущие обязательства – 1680 тыс. руб. Каким должна быть прибыль предприятия в следующие шесть месяцев, чтобы достигнуть нормативного значения коэффициента покрытия, равного двум, при условии, что сумма текущих обязательств не вырастет?

Задача 2. Определите сумму собственного капитала фирмы, если известно что сумма внеоборотных средств фирмы составляет – 1800553 тыс. руб., сумма долгосрочных обязательств – 108826 тыс. руб., краткосрочных обязательств – 1040136 тыс. руб., а сумма оборотных активов – 1015034 тыс. руб.

Задача 3. Имеются следующие данные: денежные средства – 70 тыс. руб.; краткосрочные финансовые вложения – 28 тыс. руб.; дебиторская задолженность – 130 тыс. руб.; основные средства – 265 тыс. руб.; нематериальные активы – 34 тыс. руб.; производственные запасы – 155 тыс. руб., кредиторская задолженность – 106 тыс. руб., краткосрочные кредит банка – 95 тыс. руб.; долгосрочные кредиты – 180 тыс. руб. Определите коэффициент текущей ликвидности, коэффициент срочной ликвидности, коэффициент абсолютной ликвидности.

Задача 4. Активы предприятия составляют 115 млн. руб., выручка от продаж – 196 млн. руб., рентабельность продаж – 14,5%. Определите рентабельность активов.

Задача 5. Определите рентабельность активов и источников собственных средств фирмы, если прибыль за год составила 1800 тыс. рублей, а валюта баланса на начало года составляла 36090

тыс. рублей, в том числе собственный капитал фирмы 12070 тыс. рублей, на конец года валюта баланса составила 39800 тыс. рублей, в том числе собственный капитал фирмы 13100 тыс. руб.

Задача 6. Имеются следующие данные: денежные средства – 70 тыс. руб.; краткосрочные финансовые вложения – 28 тыс. руб.; дебиторская задолженность – 130 тыс. руб.; основные средства – 265 тыс. руб.; нематериальные активы – 34 тыс. руб.; производственные запасы – 155 тыс. руб., кредиторская задолженность – 106 тыс. руб., краткосрочные кредит банка – 95 тыс. руб.; долгосрочные кредиты – 180 тыс. руб. Определите коэффициент текущей ликвидности, коэффициент срочной ликвидности, коэффициент абсолютной ликвидности.

Задача 7. Объем реализации продукции – 150 млн. Затраты на реализованную продукцию – 100 млн. Рентабельность продукции (по чистой прибыли) – 15% Рентабельность активов – 6% Рентабельность капитала – 12% Рассчитать период оборачиваемости авансированного и собственного капитала.

Задача 8. Составить отчет о прибылях и убытках компании, если известно, что фирма реализовала в отчетном периоде 250 тыс. единиц продукции по цене 10 долл. за единицу; затраты на выплату заработной платы и покупку материалов составили 1560 тыс. долл.; коммерческие и административные расходы составили 11 тыс. долл.; прочие расходы 7 тыс. долл.; ставка налога на прибыль 20 % от прибыли; амортизационный фонд за отчетный период составил 20 тыс. долл.; проценты за кредит в текущем периоде составили 40 тыс. долл. Кроме того, известно, что компания выпустила 2000 привилегированных акций номиналом 300 долл. и ставкой дивидендов 20 %.

Задача 9. Выручка от реализации 5 млн.руб. Соотношение выручки и собственных оборотных средств – 2:1 Соотношение внеоборотных и оборотных средств – 3:1 Коэффициент текущей ликвидности = 4 Определить: 1. величину текущих обязательств, 2. величину внеоборотных активов.

Задача 10. Стоимость застрахованного оборудования составляет 14 000 д.е., страховая сумма —10 000 д.е., ущерб страхователя при наступлении страхового случая —8500 д.е.

Определите страховое возмещение по системе пропорциональной ответственности и по системе первого риска.

Задача 11. Инвентарь застрахован по системе пропорциональной ответственности на сумму 8425 д.е. Оценка —9000 д.е. При какой сумме ущерба страховое возмещение будет равно 7425 д.е.?

Задача 12. Рассчитайте страховой ущерб при полной гибели сельскохозяйственного урожая, если средняя стоимость застрахованного урожая с 1 га —800 тыс. д.е, общая площадь посева —5 га.

Задача 13. При пожаре сгорело оборудование предприятия.

Исчислить страховое возмещение, если балансовая стоимость оборудования —24 000 д.е. Имущество застраховано на 90% балансовой стоимости.

Задача 14. Определите ущерб при гибели сельскохозяйственного урожая на всей площади посева, если средняя стоимость застрахованного урожая с 1 га — 25 500 д.е., общая площадь посева —200 га.

Задача 15. В результате дорожно-транспортного происшествия уничтожен автомобиль. Цена автомобиля —24 000 д.е. Износ на день заключения договора —30%.

От автомобиля остались детали на сумму 7000 д.е. На приведение в порядок указанных деталей израсходовано 2000 д.е.

Определите ущерб страхователя, если автомобиль застрахован в полной стоимости.

Задача 16. Заключен договор кредитного страхования.

Сумма непогашенного в срок кредита составляет 244 тыс. д.е.

Предел ответственности страховщика —85%.

Рассчитайте страховое возмещение.