

ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Иркутский государственный университет путей сообщения»

Красноярский институт железнодорожного транспорта

– филиал Федерального государственного бюджетного образовательного учреждения
высшего образования «Иркутский государственный университет путей сообщения»
(КрИЖТ ИрГУПС)

УТВЕРЖДЕНА

приказ ректора

от «02» июня 2023 г. № 426-1

Б1.В.ДВ.12.02 Управление рыночными рисками
рабочая программа дисциплины

Направление подготовки – 38.03.01 Экономика

Профиль – Экономическая безопасность, анализ и управление рисками

Квалификация выпускника – бакалавр

Форма и срок обучения – 4 года очная форма; 4 года 8 мес. очно-заочная форма

Кафедра-разработчик программы – Управление персоналом

Общая трудоемкость в з.е. – 3

Часов по учебному плану (УП) – 108

В том числе в форме практической
подготовки (ПП) – 4/4

(очная/очно-заочная)

Формы промежуточной аттестации в семестрах

очная форма обучения: зачет 7,

очно-заочная форма обучения: зачет 8

Очная форма обучения

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр	7	Итого
Число недель в семестре	14	
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП
Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т. ч. форме ПП*	56/4	56/4
– лекции	28	28
– практические (семинарские)	28/4	28/4
Самостоятельная работа	52	52
Итого	108	108

Очно-заочная форма обучения

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр	8	Итого
Число недель в семестре	17	
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП
Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т. ч. форме ПП*	34/4	34/4
– лекции	17	17
– практические (семинарские)	17/4	17/4
Самостоятельная работа	65	65
Зачет	9	9
Итого	108	108

КРАСНОЯРСК

Электронный документ выгружен из ЕИС ФГБОУ ВО ИрГУПС и соответствует оригиналу

Подписант ФГБОУ ВО ИрГУПС Трофимов Ю.А.

00a73c5b7b623a969ccad43a81ab346d50 с 08.12.2022 14:32 по 02.03.2024 14:32 GMT+03:00

Подпись соответствует файлу документа



Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утвержденным Приказом Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954.

Программу составил:
канд. пед. наук, доцент, доцент

А.В. Кутузова

Рабочая программа рассмотрена и одобрена для использования в учебном процессе на заседании кафедры «Управление персоналом», протокол от «11» мая 2023 г. № 9.

Заведующий кафедрой, канд. техн. наук, доцент

В.О. Колмаков

1 ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ	
1.1 Цель дисциплины	
1	формирование компетенции в области идентификации, оценки и управления рыночными рисками
1.2 Задачи дисциплины	
1	сформировать у обучающихся представление о рыночных рисках
2	сформировать у обучающихся основы применения способов и инструментов управления рыночными рисками
1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины	
Профессионально-трудовое воспитание обучающихся	
Цель профессионально-трудоустройства – формирование у обучающихся осознанной профессиональной ориентации, понимания общественного смысла труда и значимости его для себя лично, ответственного, сознательного и творческого отношения к будущей деятельности, профессиональной этики, способности предвидеть изменения, которые могут возникнуть в профессиональной деятельности, и умению работать в изменённых, вновь созданных условиях труда.	
Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:	
– формирование сознательного отношения к выбранной профессии;	
– воспитание чести, гордости, любви к профессии, сознательного отношения к профессиональному долгу, понимаемому как личная ответственность и обязанность;	
– формирование психологии профессионала;	
– формирование профессиональной культуры, этики профессионального общения;	
– формирование социальной компетентности и другие задачи, связанные с имиджем профессии и авторитетом транспортной отрасли	

2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	
2.1 Требования к предварительной подготовке обучающегося	
1	Б1.В.ДВ.11.01 Страхование
2	Б1.В.ДВ.11.02 Современные инструменты риск-менеджмента
3	Б1.В.ДВ.06.01 Методология и практика обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов
4	Б1.В.ДВ.06.02 Система обеспечения экономической безопасности организации
5	Б1.В.ДВ.02.01 Теория и методология анализа рисков
6	Б1.В.ДВ.02.02 Оценка профиля рисков организации
7	Б2.О.03(П) Производственная - технологическая (проектно-технологическая) практика
2.2 Дисциплины и практики, для которых изучение данной дисциплины необходимо как предшествующее	
1	Б1.В.ДВ.09.01 Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности
2	Б1.В.ДВ.09.02 Управление рисками операций на финансовом рынке
3	Б1.В.ДВ.13.01 Долгосрочная финансовая стратегия
4	Б1.В.ДВ.13.02 Финансовое планирование и прогнозирование
5	Б2.О.04(Пд) Производственная - преддипломная практика
6	Б3.01(Д) Подготовка к процедуре защиты выпускной квалификационной работы
7	Б3.02(Д) Защита выпускной квалификационной работы

3 ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ТРЕБОВАНИЯМИ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ		
Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения
ПК-5.1. Способен анализировать и интерпретировать информацию о деятельности хозяйствующих субъектов для	ПК-5.1.1 Составляет профиль и карту рисков хозяйствующих субъектов	Знать: основы определения характеристик рыночных рисков, необходимых для составления карты рыночных рисков; принципы и правила составления карты рыночных рисков
		Уметь: составлять карту рыночных рисков; корректировать карту рыночных рисков в соответствии с условиями развития рынков

идентификации угроз и рисков с целью составления и корректировки реестров рисков		Владеть: навыками оценки рыночных рисков и их факторов для составления карты рыночных рисков; навыками оценки результатов разработанной карты рыночных рисков
	ПК-5.1.2 Идентифицирует риски и угрозы в системе экономической безопасности	Знать: природу и источники возникновения рыночных рисков; виды и факторы рыночной неопределенности
		Уметь: собирать, систематизировать и анализировать информацию, необходимую для идентификации рыночных рисков и факторов рыночной неопределенности; идентифицировать и описывать рыночные риски в зависимости от условий функционирования рынков
		Владеть: навыками интерпретации результатов анализа информации, необходимой для идентификации факторов рыночной неопределенности и составления карты рыночных рисков; навыками оценки результатов идентификации рыночных рисков
ПК-5.3. Способен аргументировать выбор алгоритмов противодействия рискам и оценивать их последствия в системе обеспечения экономической безопасности	ПК-5.3.1 Знает и обоснованно применяет методы, способы и инструменты управления рисками	Знать: методы, способы и инструменты управления и нивелирования рыночных рисков; особенности применения инструментов управления рыночными рисками; принципы и особенности функционирования процесса управления рыночными рисками
		Уметь: анализировать информацию для выбора методов, способов и инструментов управления рисками и факторами рыночной неопределенности; обоснованно выбирать методы, способы и инструменты управления рыночными рисками в зависимости от условий функционирования различных видов рынков; планировать процесс нивелирования потенциальных угроз рыночной конъюнктуры
		Владеть: навыками оценки основных параметров рыночных рисков для обоснования инструментов управления ими; навыками формирования мероприятий нивелирования угроз рыночной неопределенности; навыками определения эффективности применяемых инструментов и мероприятий по управлению рыночными рисками

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ												
Код	Наименование разделов, тем и видов работы	Очная форма				Очно-заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции		
		Семестр	Часы			Семестр	Часы					
			Лек	Пр	Лаб		СР	Лек	Пр		Лаб	СР
1.0	Раздел 1. Сущность и основы управления рыночными рисками											
1.1	Виды товарных и финансовых рынков. Рыночная неопределенность	7	2	2	4	8	1	1		7	ПК-5.1.2	
1.2	Особенности возникновения и реализации рыночных рисков. Факторы рыночных рисков	7	2	2	4	8	1	1		8	ПК-5.1.2	
1.3	Особенности процесса управления рыночными рисками	7	4	4		8	8	2	2		6	ПК-5.3.1
2.0	Раздел 2. Процесс управления рыночными рисками											
2.1	Идентификация рыночных рисков	7	2	2		6					ПК-5.1.2	
2.2	Оценка и анализ рыночных рисков	7	2	2		4	8	2	2		6	ПК-5.1.3
2.3	Экспертный подход к оценке рыночных рисков	7	4	4		8	8	2	2		6	ПК-5.1.3
2.4	Построение и корректировка карты рыночных рисков	7	2	2		4	8	2	2		6	ПК-5.1.3
2.5	Методы и способы управления рыночными рисками	7	4	4/2		4	8	2	2/2		6	ПК-5.3.1
2.6	Прогнозирование факторов рыночной неопределенности	7	4	4/2		6	8	2	2/2		6	ПК-5.1.2
2.7	Контроль и мониторинг процесса управления рыночными рисками	7	2	2		4	8	2	2		6	ПК-5.3.1
	Итого	7	28	28		58	8	17	17		65	
	Форма промежуточной аттестации – зачет	7					8		9			ПК-5.1.2 ПК-5.1.3 ПК-5.3.1

5 ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ
Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине: оформлен в виде приложения № 1 к рабочей программе дисциплины и размещен в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет

6 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ			
6.1 Учебная литература			
6.1.1 Основная литература			
Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год издания	Кол-во экз. в библиотеке/100%

				онлайн
6.1.1.1	Воронцовски А. В.	Управление рисками : учебник и практикум для вузов [Электронный ресурс] https://urait.ru/bcode/511534	Москва : Издательство Юрайт, 2023	100% онлайн
6.1.1.2	М. Круи, Д. Гэлаи, В. Б. Минасян, Р. Марк.	Основы риск-менеджмента [Электронный ресурс] https://urait.ru/bcode/510526	Москва : Издательство Юрайт, 2023	100% онлайн
6.1.2 Дополнительная литература				
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год издания	Кол-во экз. в библиотеке/ 100% онлайн
6.1.2.1	Вяткин В. Н.	Риск-менеджмент : учебник [Электронный ресурс] https://urait.ru/bcode/511018	Москва : Издательство Юрайт, 2023	100% онлайн
6.1.2.2	Каранина Е.В.	Риск-менеджмент: учебник [Электронный ресурс] http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=576201	Москва.: Директ-Медиа, 2020	100% онлайн
6.1.3 Учебно-методические разработки (в т. ч. для самостоятельной работы обучающихся)				
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год издания/ Личный кабинет обучающегося	Кол-во экз. в библиотеке/ 100% онлайн
6.1.3.1	Кутузова А.В.	Методические материалы и указания по изучению дисциплины	Личный кабинет обучающегося, ЭИОС	100% онлайн
6.2 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»				
6.2.1	Библиотека КрИЖТ ИрГУПС : [сайт] / Красноярский институт железнодорожного транспорта –филиал ИрГУПС. – Красноярск. – URL: http://irbis.krsk.irkups.ru/ . – Режим доступа: после авторизации. – Текст: электронный.			
6.2.2	Электронная библиотека «УМЦ ЖДТ» : электронно-библиотечная система : сайт / ФГБУ ДПО «Учебно-методический центр по образованию на железнодорожном транспорте». – Москва, 2013-2023. – URL: http://umczdt.ru/books/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный.			
6.2.3	Znanium.com : электронно-библиотечная система : сайт / ООО «ЗНАНИУМ». – Москва, 2011-2023. – URL: http://znanium.com . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный.			
6.2.4	Образовательная платформа Юрайт : электронная библиотека : сайт / ООО «Электронное издательство Юрайт». – Москва, 2020-2023. – URL: https://urait.ru/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный			
6.2.5	Лань : электронно-библиотечная система : сайт / Издательство Лань. – Санкт-Петербург, 2011-2023. – URL: http://e.lanbook.com . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный.			
6.2.6	Университетская библиотека онлайн : электронная библиотека : сайт / ООО «Директ-Медиа». – Москва, 2006-2023. – URL: https://biblioclub.ru/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный.			
6.2.7	Красноярский институт железнодорожного транспорта : [электронная информационно-образовательная среда] / Красноярский институт железнодорожного транспорта. – Красноярск. – URL: http://sdo.krsk.irkups.ru/ . – Текст: электронный.			
6.2.8	Российские железные дороги : официальный сайт / ОАО «РЖД». – Москва, 2003-2023. – URL: http://www.rzd.ru/ . – Текст: электронный.			
6.2.9	Национальная электронная библиотека : федеральный проект : сайт / Министерство Культуры РФ. – Москва, 2016-2023. – URL: https://rusneb.ru/ . – Режим доступа: по подписке. – Текст : электронный			
6.3 Программное обеспечение и информационные справочные системы				
6.3.1 Базовое программное обеспечение				
6.3.1.1	Microsoft Windows Vista Business Russian, авторизационный номер лицензиата 64787976ZZS1011, номер лицензии 44799789. Microsoft Office Standard 2013 Russian OLP NL Academic Edition (дог №2 от 29.05.2014 – 100 лицензий; дог №0319100020315000013-00 от 07.12.2015 – 87 лицензий).			
6.3.2 Специализированное программное обеспечение				
6.3.2.1	Не используется			
6.3.3 Информационные справочные системы				
6.3.3.1	Красноярский центр научно-технической информации и библиотек (КрЦНТИБ) : сайт. – Красноярск. –			

	URL: http://denti.krw.rzd . – Режим доступа: из локальной сети вуза. – Текст : электронный
6.3.3.2	Гарант : справочно-правовая система база данных / ООО «ИПО «ГАРАНТ». – Режим доступа : из локальной сети вуза. – Текст : электронный.
6.3.3.3	Автоматизированная система правовой информации на железнодорожном транспорте (БД АСПИЖТ) : сайт КонсультантПлюс / АО НИИАС. – Режим доступа : из локальной сети вуза. – Текст : электронный.
6.4 Правовые и нормативные документы	
6.4.1	Не используется
7 ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ	
1	Корпуса А, Л, Т, Н КрИЖТ ИрГУПС находятся по адресу г. Красноярск, ул. Новая Заря, д. 2 И
2	Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых проектов, работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, укомплектованные специализированной мебелью и техническими средствами обучения (ноутбук, проектор, экран), служащими для представления учебной информации большой аудитории. Для проведения занятий лекционного типа имеются учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты, таблицы), обеспечивающие тематические иллюстрации содержания дисциплины.
3	Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, подключенной к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду КрИЖТ ИрГУПС. Помещения для самостоятельной работы обучающихся: – читальный зал библиотеки; – компьютерные классы А-224, А-409, А-414, Л-203, Л-204, Л-214, Л-404, Л-410, Н-204, Н-207, Т-46, Т-5.

8 МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ	
Вид учебной деятельности	Организация учебной деятельности обучающегося
Лекция	<p>Лекция (от латинского «lection» – чтение) – вид аудиторных учебных занятий. Лекция: закладывает основы научных знаний в систематизированной, последовательной, обобщенной форме; раскрывает состояние и перспективы развития соответствующей области науки и техники; концентрирует внимание обучающихся на наиболее сложных, узловых вопросах; стимулирует познавательную активность обучающихся.</p> <p>Во время лекционных занятий обучающийся должен уметь сконцентрировать внимание на изучаемых проблемах и включить в работу все виды памяти: словесную, образную и моторно-двигательную. Для этого весь материал, излагаемый преподавателем, обучающемуся необходимо конспектировать. В конспект рекомендуется выписывать определения, формулы и т.п. На полях конспекта следует пометить вопросы, выделенные обучающимся для консультации с преподавателем. Выводы, полученные в виде формул, рекомендуется в конспекте подчеркивать или обводить рамкой, чтобы лучше запоминались. Полезно составить краткий справочник, содержащий определения важнейших понятий и наиболее часто употребляемые формулы дисциплины. К каждой лекции следует разобрать материал предыдущей лекции. Изучая материал по учебнику или конспекту лекций, следует переходить к следующему вопросу только в том случае, когда хорошо усвоен предыдущий вопрос. При этом необходимо воспроизводить на бумаге все рассуждения, как имеющиеся в учебнике или конспекте, так и пропущенные в силу их простоты. Ряд вопросов дисциплины может быть вынесен на самостоятельное изучение. Такое задание требует оперативного выполнения. В конспекте лекций необходимо оставить место для освещения упомянутых вопросов. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, то необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии</p>
Практическое занятие	<p>Практическое занятие – вид аудиторных учебных занятий, целенаправленная форма организации учебного процесса, при реализации которой обучающиеся по заданию и под руководством преподавателя выполняют практические задания. Практические задания направлены на углубление научно-теоретических знаний и овладение определенными методами работы, в процессе которых вырабатываются умения и навыки выполнения тех или иных учебных действий в данной сфере науки. Практические занятия развивают научное мышление и речь, позволяют проверить знания обучающихся, выступают как средства оперативной обратной связи; цель практических занятий – углублять, расширять,</p>

	<p>детализировать знания, полученные на лекции, в обобщенной форме и содействовать выработке навыков профессиональной деятельности.</p> <p>На практических занятиях подробно рассматриваются основные вопросы дисциплины, разбираются основные типы задач. К каждому практическому занятию следует заранее самостоятельно выполнить домашнее задание и выучить лекционный материал к следующей теме. Систематическое выполнение домашних заданий обязательно и является важным фактором, способствующим успешному усвоению дисциплины.</p> <p>Особое внимание следует обращать на определение основных понятий дисциплины. Обучающийся должен подробно разбирать примеры, которые поясняют понятия</p> <p>Практическая подготовка, включаемая в практические занятия, предполагает выполнение обучающимся отдельных элементов работ, связанных с будущей профессиональной деятельностью (выработка мероприятий по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и их экономическая оценка; документирование процесса управления рисками и корректировка реестров рисков в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений).</p>
Самостоятельная работа	<p>Обучение по дисциплине «Управление рыночными рисками» предусматривает активную самостоятельную работу обучающегося. На самостоятельную работу отводится 52 часа по очной форме обучения, 65 часов по очно-заочной форме обучения. В разделе 4 рабочей программы, который называется «Структура и содержание дисциплины», все часы самостоятельной работы расписаны по темам и вопросам, а также указана необходимая учебная литература: обучающийся изучает учебный материал, разбирает примеры и решает разноуровневые задачи в рамках выполнения как общих домашних заданий, так и индивидуальных домашних заданий (ИДЗ). При выполнении домашних заданий обучающемуся следует обратиться к задачам, решенным на предыдущих практических занятиях, решенным домашним работам, а также к примерам, приводимым лектором. Если этого будет недостаточно для выполнения всей работы можно дополнительно воспользоваться учебными пособиями, приведенными в разделе 6.1 «Учебная литература». Если, несмотря на изученный материал, задание выполнить не удастся, то в обязательном порядке необходимо посетить консультацию преподавателя, ведущего практические занятия, и/или консультацию лектора.</p> <p>ИДЗ должны быть выполнены обучающимся в установленные преподавателем сроки в соответствии с требованиями к оформлению (текстовой и графической частей), сформулированным в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль».</p> <p>Обучающийся очной и очно-заочной формы обучения выполняет: 7,8 семестр ИДЗ № 1 «Решение профессиональной задачи в сфере управления рыночными рисками». Задания размещены в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.</p>
Комплекс учебно-методических материалов по всем видам учебной деятельности, предусмотренным рабочей программой дисциплины, размещен в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.	

**Приложение 1 к рабочей программе по дисциплине
Б1.В.ДВ.12. 02 Управление рыночными рисками**

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

**для проведения текущего контроля успеваемости
и промежуточной аттестации по дисциплине**

Б1.В.ДВ.12.02 Управление рыночными рисками

1. Общие положения

Фонд оценочных средств (ФОС) является составной частью нормативно-методического обеспечения системы оценки качества освоения обучающимися образовательной программы.

Фонд оценочных средств предназначен для использования обучающимися, преподавателями, администрацией КрИЖТ ИрГУПС, а также сторонними образовательными организациями для оценивания качества освоения образовательной программы и уровня сформированности компетенций у обучающихся.

Задачами ФОС являются:

- оценка достижений обучающихся в процессе изучения дисциплины;
- обеспечение соответствия результатов обучения задачам будущей профессиональной деятельности через совершенствование традиционных и внедрение инновационных методов обучения в образовательный процесс;
- самоподготовка и самоконтроль обучающихся в процессе обучения.

Фонд оценочных средств сформирован на основе ключевых принципов оценивания: валидность, надежность, объективность, эффективность.

Для оценки уровня сформированности компетенций используется трехуровневая система:

- минимальный уровень освоения, обязательный для всех обучающихся по завершению освоения образовательной программы; дает общее представление о виде деятельности, основных закономерностях функционирования объектов профессиональной деятельности, методов и алгоритмов решения практических задач;
- базовый уровень освоения, превышение минимальных характеристик сформированности компетенций; позволяет решать типовые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения по известным алгоритмам, правилам и методикам;
- высокий уровень освоения, максимально возможная выраженность характеристик компетенций; предполагает готовность решать практические задачи повышенной сложности, нетиповые задачи, принимать профессиональные и управленческие решения в условиях неполной определенности, при недостаточном документальном, нормативном и методическом обеспечении.

2. Перечень компетенций, в формировании которых участвует дисциплина.

Программа контрольно-оценочных мероприятий.

Показатели оценивания компетенций, критерии оценки

Дисциплина «Управление рыночными рисками» участвует в формировании компетенций:

ПК-5.1. Способен анализировать и интерпретировать информацию о деятельности хозяйствующих субъектов для идентификации угроз и рисков с целью составления и корректировки реестров рисков

ПК-5.3. Способен аргументировать выбор алгоритмов противодействия рискам и оценивать их последствия в системе обеспечения экономической безопасности

Программа контрольно-оценочных мероприятий очная форма обучения

№	Неделя	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля (понятие/тем/раздел и т.д. дисциплины)	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
7 семестр					

1	1	Текущий контроль	1. 1. Виды товарных и финансовых рынков. Рыночная неопределенность	ПК-5.1.2	Собеседование (устно)
2	2	Текущий контроль	1. 2. Особенности возникновения и реализации рыночных рисков. Факторы рыночных рисков	ПК-5.3.1	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
3	3-4	Текущий контроль	1. 3. Особенности процесса управления рыночными рисками	ПК-5.1.2	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
4	4	Текущий контроль	Раздел 1. Сущность и основы управления рыночными рисками	ПК-5.1.2 ПК-5.3.1	Тестирование (компьютерные технологии)
5	5	Текущий контроль	2.1 Идентификация рыночных рисков	ПК-5.1.3	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
6	6	Текущий контроль	2.2 Оценка и анализ рыночных рисков	ПК-5.1.3	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
7	7-8	Текущий контроль	2.3 Экспертный подход к оценке рыночных рисков	ПК-5.1.3	Собеседование (устно)
8	9	Текущий контроль	2.4. Построение и корректировка карты рыночных рисков	ПК-5.3.1	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
9	10-11	Текущий контроль	2.5 Методы и способы управления рыночными рисками	ПК-5.3.1	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Задания творческого уровня (письменно)
10	12-13	Текущий контроль	2.6 Прогнозирование факторов рыночной неопределенности	ПК-5.3.1	В рамках ПП**: Задания творческого уровня (письменно)
11	14	Текущий контроль	2.7 Контроль и мониторинг процесса управления рыночными рисками	ПК-5.3.1	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
12	14	Текущий контроль	Раздел 2. Процесс управления рыночными рисками	ПК-5.1.2 ПК-5.1.3 ПК-5.3.1	Тестирование (компьютерные технологии)
13	14	Промежуточная аттестация - зачет	Раздел 1. Сущность и основы управления рыночными рисками Раздел 2. Процесс управления рыночными рисками	ПК-5.1.2 ПК-5.1.3 ПК-5.3.1	Вопросы и практически задания (устно)

*Форма проведения контрольно-оценочного мероприятия: устно, письменно, компьютерные технологии.

Программа контрольно-оценочных мероприятий очно-заочная форма обучения

№	Неделя	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля (понятие/тем/раздел и т.д. дисциплины)	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
8 семестр					
1	1-2	Текущий контроль	1. 1. Виды товарных и финансовых рынков. Рыночная неопределенность	ПК-5.1.2	Собеседование (устно)
2	3-4	Текущий контроль	1. 2. Особенности возникновения и реализации рыночных рисков. Факторы рыночных рисков	ПК-5.3.1	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
3	5-6	Текущий контроль	1. 3. Особенности процесса управления рыночными рисками	ПК-5.1.2	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
4	4	Текущий контроль	Раздел 1. Сущность и основы управления рыночными рисками	ПК-5.1.2 ПК-5.3.1	Тестирование (компьютерные технологии)
5	7-8	Текущий контроль	2.1 Идентификация рыночных рисков	ПК-5.1.3	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
6	9-10	Текущий контроль	2.2 Оценка и анализ рыночных рисков	ПК-5.1.3	Собеседование (устно)

					Задания реконструктивного уровня (письменно)
7	10-11	Текущий контроль	2.3 Экспертный подход к оценке рыночных рисков	ПК-5.1.3	Собеседование (устно)
8	12-13	Текущий контроль	2.4. Построение и корректировка карты рыночных рисков	ПК-5.3.1	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
9	14	Текущий контроль	2.5 Методы и способы управления рыночными рисками	ПК-5.3.1	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Задания творческого уровня (письменно)
10	15	Текущий контроль	2.6 Прогнозирование факторов рыночной неопределенности	ПК-5.3.1	В рамках ПП**: Задания творческого уровня (письменно)
11	16	Текущий контроль	2.7 Контроль и мониторинг процесса управления рыночными рисками	ПК-5.3.1	Собеседование (устно) Задания реконструктивного уровня (письменно)
12	14	Текущий контроль	Раздел 2. Процесс управления рыночными рисками	ПК-5.1.2 ПК-5.1.3 ПК-5.3.1	Тестирование (компьютерные технологии)
12	17	Промежуточная аттестация - зачет	Раздел 1. Сущность и основы управления рыночными рисками Раздел 2. Процесс управления рыночными рисками	ПК-5.1.2 ПК-5.1.3 ПК-5.3.1	Вопросы и практически задания (устно)

*Форма проведения контрольно-оценочного мероприятия: устно, письменно, компьютерные технологии.

Описание показателей и критериев оценивания компетенций.

Описание шкал оценивания

Контроль качества освоения дисциплины включает в себя текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию. Текущий контроль успеваемости и промежуточная аттестация обучающихся проводятся в целях установления соответствия достижений обучающихся поэтапным требованиям образовательной программы к результатам обучения и формирования компетенций.

Текущий контроль успеваемости – основной вид систематической проверки знаний, умений, навыков обучающихся. Задача текущего контроля – оперативное и регулярное управление учебной деятельностью обучающихся на основе обратной связи и корректировки. Результаты оценивания учитываются в виде средней оценки при проведении промежуточной аттестации.

Перечень оценочных средств, используемых для оценивания компетенций, а также краткая характеристика этих средств приведены в таблице

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	Собеседование	Средство контроля на практическом занятии, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Может быть использовано для оценки знаний обучающихся	Вопросы по темам/разделам дисциплины
2	Разноуровневые задания	Различают задачи и задания: – реконструктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения синтезировать, анализировать, обобщать фактический и теоретический материал с формулированием конкретных выводов, установлением причинно-следственных связей; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся;	Комплект разноуровневых задач и заданий или комплекты задач и заданий определенного уровня

		– творческого уровня, позволяющие оценивать и диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения; может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	
3	Тестирование	Система стандартизированных заданий, позволяющая автоматизировать процедуру измерения уровня знаний и умений обучающегося. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Типовые тестовые задания по дисциплине
4	Зачет	Средство, позволяющее оценить знания, умения, навыков и (или) опыта деятельности обучающегося по дисциплине. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Перечень теоретических вопросов и практических заданий (билетов) к зачету

Критерии и шкалы оценивания компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета. Шкала оценивания уровня освоения компетенций

Шкалы оценивания	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенции
«зачтено»	Обучающийся правильно ответил на теоретические вопросы. Показал отличные знания в рамках учебного материала. Правильно выполнил практические задания. Показал отличные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на все дополнительные вопросы	Высокий
	Обучающийся с небольшими неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал хорошие знания в рамках учебного материала. С небольшими неточностями выполнил практические задания. Показал хорошие умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Ответил на большинство дополнительных вопросов	Базовый
	Обучающийся с существенными неточностями ответил на теоретические вопросы. Показал удовлетворительные знания в рамках учебного материала. С существенными неточностями выполнил практические задания. Показал удовлетворительные умения и владения навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Допустил много неточностей при ответе на дополнительные вопросы	Минимальный
«не зачтено»	Обучающийся при ответе на теоретические вопросы и при выполнении практических заданий продемонстрировал недостаточный уровень знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. При ответах на дополнительные вопросы было допущено множество неправильных ответов	Компетенция не сформирована

Критерии и шкалы оценивания результатов обучения при проведении текущего контроля успеваемости

Собеседование

Шкала оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Глубокое и прочное усвоение программного материала. Полные, последовательные, грамотные и логически излагаемые ответы при видоизменении задания. Обучающийся свободно справляется с поставленными задачами, может обосновать принятые решения, демонстрирует владение разносторонними навыками и приемами выполнения практических работ
«хорошо»		Знание программного материала, грамотное изложение, без существенных неточностей в ответе на вопрос, правильное

		применение теоретических знаний, владение необходимыми навыками при выполнении практических задач
«удовлетворительно»		Обучающийся демонстрирует усвоение основного материала, при ответе допускаются неточности, при ответе недостаточно правильные формулировки, нарушение последовательности в изложении программного материала, затруднения в выполнении практических заданий Слабое знание программного материала, при ответе возникают ошибки, затруднения при выполнении практических работ
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Не было попытки выполнить задание

Задания реконструктивного уровня

Шкала оценивания		Критерии оценивания
«отлично»		Обучающийся полностью и правильно выполнил задания. Показал отличные знания, умения и владения навыками применения их при решении задач в рамках усвоенного учебного материала. Работа оформлена аккуратно и в соответствии с предъявляемыми требованиями
«хорошо»	«зачтено»	Обучающийся выполнил задания с небольшими неточностями. Показал хорошие знания, умения и владения навыками применения их при решении задач в рамках усвоенного учебного материала. Есть недостатки в оформлении работы
«удовлетворительно»		Обучающийся выполнил задания с существенными неточностями. Показал удовлетворительные знания, умения и владения навыками применения их при решении задач в рамках усвоенного учебного материала. Качество оформления работы имеет недостаточный уровень
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	При выполнении заданий обучающийся продемонстрировал недостаточный уровень знаний, умений и владения ими при решении задач в рамках усвоенного учебного материала

Задание творческого уровня

Шкала оценивания		Критерии оценивания
«отлично»		Представленная работа демонстрирует точное понимание задания и полное ему соответствие. В работе приводятся конкретные факты и примеры. Материал изложен логично. Работа и форма её представления является авторской, выполнена самостоятельно и содержит большое число оригинальных, изобретательных примеров. Эффективное использование изображений, видео, аудио и других мультимедийных возможностей, чтобы представить свою тему и вызвать интерес. Презентация имеет все необходимые разделы, данные об авторе, ссылки на источники, оформлена в одном стиле. Текст не избыточен на слайде, не имеет орфографических и речевых ошибок
«хорошо»	«зачтено»	Представленная работа демонстрирует понимание задания. В работу включаются как материалы, имеющие как непосредственное отношение к теме, так и материалы, не имеющие отношения к ней. Содержание работы соответствует заданию, но не все аспекты задания раскрыты. В работе есть элементы творчества. Используются однотипные мультимедийные возможности, или некоторые из них отвлекают внимание от темы презентации. Основные требования к презентации соблюдены, но отсутствует выполнение требований либо к оформлению, либо к содержанию. Текст на слайде не избыточен, но плохо читается, несколько неудачных речевых выражений.
«удовлетворительно»		В работу включена собранная обучающимся информация, но она не анализируется и не оценивается. Нарушение логики в

		изложении материала. Обычная, стандартная работа, элементы творчества отсутствуют. Не используются изображения, видео, аудио и другие мультимедийные возможности, или их использование отвлекает внимание. Не соблюдены требования к оформлению презентации. Слишком много текста, или две и более орфографических ошибок, или речевые и орфографические ошибки
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Включены материалы, не имеющие непосредственного отношения к теме работы, содержание работы не относится в рассматриваемой проблеме. Отсутствует логики в изложении материала. Не используются изображения, видео, аудио и другие мультимедийные возможности, или их использование отвлекает внимание. Не соблюдены требования к оформлению презентации

Критерии и шкала оценивания тестов

Шкала оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Обучающийся верно ответил на 90 – 100 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«хорошо»		Обучающийся верно ответил на 80 – 89 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«удовлетворительно»		Обучающийся верно ответил на 70 – 79 % тестовых заданий при прохождении тестирования
«не удовлетворительно»	«не зачтено»	Обучающийся верно ответил на 69 % и менее тестовых заданий при прохождении тестирования

3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

3.1 Типовые вопросы для собеседования

Образец типовых вопросов для собеседования

по теме «Виды товарных и финансовых рынков. Рыночная неопределенность»

- 1 Сущность рыночной экономики
- 2 Функционирование товарных рынков
- 3 Функционирование финансовых рынков
- 4 Сегменты финансового рынка
- 5 Сущность рыночной неопределенности

Образец типовых вопросов для собеседования

по теме «Особенности возникновения и реализации рыночных рисков. Факторы рыночных рисков»

- 1 Причины возникновения рыночных рисков
- 2 Последствия реализации рыночных рисков
- 3 Возможности прогнозирования рыночных рисков
- 4 Источники рыночных рисков
- 5 Факторы рыночных рисков

Образец типовых вопросов для собеседования

по теме «Особенности процесса управления рыночными рисками»

- 1 Сущность процесса управления рыночными рисками
- 2 Необходимость управления рыночными рисками
- 3 Этапы процесса управления рыночными рисками
- 4 Методы управления рыночными рисками
- 5 Способы управления рыночными рисками

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Идентификация рыночных рисков»

- 1 Сущность идентификации рыночных рисков
- 2 Необходимость идентификации рыночных рисков
- 3 Этапы идентификации рыночных рисков
- 4 Методы и способы идентификации рыночных рисков
- 5 Карта рыночных рисков как результат идентификации и описания рыночных рисков

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Оценка и анализ рыночных рисков»

- 1 Подходы к оценке рыночных рисков
- 2 Подходы к анализу рыночных рисков
- 3 Этапы анализа рыночных рисков
- 4 Показатели оценки рисков
- 5 Структурные характеристики риска как результаты оценки

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Экспертный подход к оценке рыночных рисков»

- 1 Случаи применения экспертного подхода при оценке и анализе рыночных рисков
- 2 Виды методов оценки рыночных рисков в экспертном подходе
- 3 Метод Дельфи
- 4 Этапы реализации метода Дельфи
- 5 Особенности результатов оценки рыночных рисков при экспертном подходе

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Построение и корректировка карты рыночных рисков»

- 1 Сущность карты рыночных рисков
- 2 Назначение карты рыночных рисков
- 3 Этапы составления карты рыночных рисков
- 4 Необходимость корректировки карты рыночных рисков
- 5 Этапы корректировки карты рыночных рисков

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Методы и способы управления рыночными рисками»

- 1 Сущность метода передачи в управлении рисками
- 2 Способы метода передачи в управлении рисками
- 3 Особенности страхования как способа управления рисками
- 4 Сущность хеджирования при управлении рисками
- 5 Преимущества и недостатки метода передачи

Образец типовых вопросов для собеседования
по теме «Контроль и мониторинг процесса управления рыночными рисками»

- 1 Сущность контроля при управлении рыночными рисками
- 2 Сущность мониторинга при управлении рыночными рисками
- 3 Объекты контроля при управлении рыночными рисками
- 4 Объекты мониторинга при управлении рыночными рисками
- 5 Этапы мониторинга при управлении рыночными рисками

3.2 Типовые контрольные задания реконструктивного уровня

Задания выложены в электронной информационно-образовательной среде КриЖТ ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведены образцы типовых вариантов заданий реконструктивного уровня, предусмотренных рабочей программой.

Образец типового варианта заданий реконструктивного уровня
по теме «Особенности возникновения и реализации рыночных рисков. Факторы рыночных рисков»

Задание: На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, представить возможное влияние процесса управления рыночными рисками на основные направления деятельности. Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей.

Вид деятельности	Основные процессы в данной деятельности	Возможное влияние рыночных рисков на реализацию процесса	Влияние процесса управления рыночными рисками
Операционная	Изготовление продукции	...	
	
	
Финансовая	Получение кредитов и займов	...	
	
	
Инвестиционная	Обновление оборудования	...	
	
	

Образец типового варианта заданий реконструктивного уровня
по теме «Особенности процесса управления рыночными рисками»

Задание:

1. На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, представить основные структурные подразделения, ответственные за различные этапы управления рыночными рисками. Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей.

Этап процесса управления рыночными рисками	Суть этапа	Ответственное подразделение или лицо
Идентификация		
Оценка		
Анализ		
Выбор метода управления		
Применение метода		
Контроль		
Мониторинг		

2. На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, рассмотреть возможности управления рисками по определенным уровням. Предположить возможные изменения для деятельности организации при разделении процесса управления рыночными рисками на уровни.

Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей.

Уровень процесса управления рыночными рисками	Возможные рыночные риски для управления	Возможные подразделения для управления	Влияние на деятельность организации
Стратегический			
Тактический			
Оперативный			

Образец типового варианта заданий реконструктивного уровня
по теме «Идентификация рыночных рисков»

Задание:

1. На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, выделить рыночные риски, сопутствующие деятельности. В соответствии с выделенными рыночными рисками составить классификацию, обосновать признаки ранжирования.

Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей. Можно использовать любые признаки ранжирования.

1 уровень классификации	2 уровень классификации	Риск	Сущность риска
Внутренние	Операционные
	
	Финансовые
	
	Инвестиционные
	
Внешние	Приближенные
	
	Отдаленные
	

2. На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, описать выделенные рыночные риски. Определить причину, источник и факторы рисков.

Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей.

Рыночный риск	Причина	Источники	Факторы
...
...
...

Образец типового варианта заданий реконструктивного уровня
по теме «Оценка и анализ рыночных рисков»

Задание: На основании информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, собрать информацию, необходимую для оценки идентифицированных рыночных рисков.

Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей.

Рыночный риск	Показатель, необходимый для оценки рыночного риска	Число случаев наступления конкретного уровня потерь	Общее число случаев в статистической выборке, включающее и успешно осуществленные операции данного вида	Максимально возможный ущерб, который может понести организация по данному риску
...
...
...

Образец типового варианта заданий реконструктивного уровня
по теме «Построение и корректировка карты рыночных рисков»

Задание: На основании ранее выполненных заданий:

1. Составить карту рисков организации. Для графического представления рыночных рисков использовать две основные характеристики: вероятность возникновения и возможный ущерб от реализации.
2. Определить толерантность организации к рыночному риску.
3. Определить возможные изменения в основных характеристиках рыночных рисков из-за взаимовлияния.

Образец типового варианта заданий реконструктивного уровня

по теме «Контроль и мониторинг процесса управления рыночными рисками»

Задание: Опираясь на общедоступную аналитическую информацию о внешней и внутренней среде организации, выбранной для выполнения практических работ:

1 Выбрать рыночные риски, управление которыми целесообразно осуществлять методом передачи. Определить наиболее подходящие способы управления. Обосновать свой выбор. привести аргументы невозможности использования других методов.

2 Выбрать рыночные риски, управление которыми целесообразно осуществлять способом хеджирования. Представить основные инструменты хеджирования по рискам. Обосновать целесообразность использования хеджирования.

3 Выбрать рыночные риски, управление которыми целесообразно осуществлять способом страхования. Представить основные виды страхования по рискам.

4 Составить программу комплексного страхования организации.

3.3 Типовые контрольные задания творческого уровня

Задания выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет.

Ниже приведены образцы типовых вариантов заданий творческого уровня, предусмотренных рабочей программой.

Образец типового варианта заданий творческого уровня

выполняемой рамках практической подготовки,

по теме «Методы и способы управления рыночными рисками»

(трудовая функция В/01.6; трудовые действия, связанные с будущей профессиональной деятельностью: Выработка мероприятий по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и их экономическая оценка)

Задание: Опираясь на общедоступную аналитическую информацию о внешней и внутренней среде организации, выбранной для выполнения практических работ:

1 Выбрать рыночные риски, управление которыми целесообразно осуществлять методом отказа. Определить наиболее подходящие способы управления. Обосновать свой выбор. привести аргументы невозможности использования других методов.

2 Выбрать рыночные риски, управление которыми целесообразно осуществлять методом принятия. Определить наиболее подходящие способы управления. Обосновать свой выбор. привести аргументы невозможности использования других методов.

3 Составить риск-ориентированный бюджет для организации по основным статьям затрат

Образец типового варианта заданий творческого уровня

выполняемой рамках практической подготовки,

по теме «Прогнозирование факторов рыночной неопределенности»

(трудовая функция В/01.6; трудовые действия, связанные с будущей профессиональной деятельностью: Выработка мероприятий по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и их экономическая оценка)

Задание: Опираясь на общедоступную аналитическую информацию о внешней и внутренней среде организации, выбранной для выполнения практических работ:

1 Выбрать рыночные риски, управление которыми целесообразно осуществлять методом снижения. Определить наиболее подходящие способы управления. Обосновать свой выбор. привести аргументы невозможности использования других методов.

2 Выбрать рыночные риски, управление которыми целесообразно осуществлять способом лимитирования. Представить основные показатели лимитирования по рискам.

3 Выбрать рыночные риски, управление которыми целесообразно осуществлять способом диверсификации. Представить основные параметры диверсификации по рискам.

4 Выбрать рыночные риски, управление которыми целесообразно осуществлять способом реализации превентивных мероприятий. Представить основные превентивные мероприятия по рискам.

3.4 Типовые тестовые задания

Тестирование проводится по окончании и в течение семестра по завершению изучения дисциплины и раздела (контроль/проверка остаточных знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности). Компьютерное тестирование обучающихся по разделам и дисциплине используется при проведении текущего контроля знаний обучающихся. Результаты тестирования могут быть использованы при проведении промежуточной аттестации.

Тесты формируются из фонда тестовых заданий по дисциплине.

Тест (педагогический тест) – это система заданий – тестовых заданий возрастающей трудности, специфической формы, позволяющая эффективно измерить уровень знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся.

Тестовое задание (ТЗ) – варьирующаяся по элементам содержания и по трудности единица контрольного материала, минимальная составляющая единица сложного (составного) педагогического теста, по которой испытуемый в ходе выполнения теста совершает отдельное действие.

Фонд тестовых заданий (ФТЗ) по дисциплине – это совокупность систематизированных диагностических заданий – тестовых заданий (ТЗ), разработанных по всем тематическим разделам (дидактическим единицам) дисциплины (прошедших апробацию, экспертизу, регистрацию и имеющих известные характеристики) специфической формы, позволяющей автоматизировать процедуру контроля.

Типы тестовых заданий:

ЗТЗ – тестовое задание закрытого типа (ТЗ с выбором единственного ответа, ТЗ с множественным выбором нескольких ответов, ТЗ с установлением соответствия между определенными элементами, действиями, событиями, процессами и т.д., ТЗ с установлением правильной последовательности);

ОТЗ – тестовое задание открытого типа (с конструируемым ответом: ТЗ с кратким регламентированным ответом (ТЗ дополнения); ТЗ свободного изложения (с развернутым ответом в произвольной форме); числовой вопрос).

Структура тестовых материалов по дисциплине «Управление рыночными рисками»

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД (с соответствующим номером)	Содержательный элемент	Характеристика содержательного элемента	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
ПК-5.1.1 Составляет профиль и карту рисков хозяйствующих субъектов ПК-5.1.2 Идентифицирует риски и угрозы в системе экономической безопасности	1. 1. Виды товарных и финансовых рынков. Рыночная неопределенность	Сущность риска как экономической категории	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Рыночная неопределенность	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Причины возникновения неопределенности и риска в деятельности организации	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
ПК-5.3.1 Знает и обоснованно применяет методы,	1. 2. Особенности возникновения и реализации рыночных	Особенности возникновения рыночных рисков	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ

способы и инструменты управления рисками	рисков. Факторы рыночных рисков	Особенности реализации рыночных рисков	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Факторы рыночных рисков	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	1. 3. Особенности процесса управления рыночными рисками	Принципы управления рисками	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Этапы управления рисками	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Уровни управления рисками	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	2.1 Идентификация рыночных рисков	Идентификация рисков	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Оценка рисков	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Анализ рисков	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	2.2 Оценка и анализ рыночных рисков	Сущность и содержание оценки и анализа рисков	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Этапы оценки и анализа рисков	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Система оценки и анализа рисков	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	2.3 Экспертный подход к оценке рыночных рисков	Экспертный подход	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Оценка рыночных рисков	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Экспертный подход к оценке рыночных рисков	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	2.4 Построение и корректировка карты рыночных рисков	Карта рисков	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Этапы построения карты рисков	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Корректировка карты рисков	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	2.5 Методы и способы управления рыночными рисками	Сущность методов управления рисками	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Этапы применения методов управления рисками	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Методы управления рисками	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	2.6 Прогнозирование факторов рыночной неопределенности	Факторы рыночной неопределенности	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Методы прогнозирования	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Прогнозирование факторов рыночной неопределенности	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	2.7 Контроль и мониторинг процесса управления рыночными рисками	Сущность контроля процесса управления рисками	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Мониторинг процесса управления рисками	Умение	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Методы контроля и мониторинга процесса управления риска	Действие	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	Итого			

Полный комплект ФТЗ хранится в электронной информационно-образовательной среде КрИЖТ ИрГУПС и обучающийся имеет возможность ознакомиться с демонстрационным вариантом ФТЗ.

Ниже приведен образец типового варианта итогового теста, предусмотренного рабочей программой дисциплины

**Образец типового варианта итогового теста,
предусмотренного рабочей программой дисциплины**

Норма времени – 45 мин.

Количество ОТЗ – 9 (50%), ЗТЗ – 9 (50%)

1. Риск – это...
2. Метод оценки риска, который реализуется путем введения поправки на риск или путем учета вероятности возникновения денежных потоков
3. Метод оценки риска, который используется в ситуациях, когда принимаемые решения сильно зависят от принятых ранее и определяют сценарии дальнейшего развития событий?
4. Метод оценки риска, который представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты
5. Финансовый риск – это
6. Субъект управления в риск-менеджменте – это...
7. Объект управления в риск-менеджменте – это ...
8. «Деятельность любой организации всегда сопровождается рисками, присутствующими в ее внешней или внутренней среде» включает в себя смысл закона ...
9. Последовательность этапов процесса управления рисками:
 - а) «выявление риска и оценка вероятности его реализации и масштаба последствий, определение максимально возможного убытка;
 - б) выбор методов и инструментов управления выявленным риском;
 - в) разработка риск-стратегии с целью снижения вероятности реализации риска и минимизации возможных негативных последствий;
 - г) реализация риск-стратегии;
 - д) оценка достигнутых результатов и корректировка риск-стратегии.
10. Прогнозирование внешней обстановки относится к:
 - а) методы компенсации рисков
 - б) методы уклонения от рисков
 - в) методы локализации рисков
 - г) методы диверсификации рисков
11. Страхование относится к:
 - а) методы уклонения от рисков
 - б) методы диверсификации рисков
 - в) методы локализации рисков
 - г) методы компенсации рисков
12. Распределение риска по этапам работы относится к:
 - а) методы локализации рисков
 - б) методы компенсации рисков
 - в) методы уклонения от рисков
 - г) методы диверсификации рисков
13. 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
14. Обучение и инструктирование персонала относится к:
- а) методы уклонения от рисков
 - б) методы компенсации рисков
 - в) методы диверсификации рисков
 - г) методы локализации рисков
15. Распределение ответственности между участниками проекта относится к:
- а) методы диверсификации рисков
 - б) методы компенсации рисков
 - в) методы локализации рисков
 - г) методы уклонения от рисков
16. Увольнение некомпетентных сотрудников относится к:
- а) методы локализации рисков
 - б) методы диверсификации рисков
 - в) методы уклонения от рисков
 - г) методы компенсации рисков
17. Создание системы резервов относится к:
- а) методы уклонения от рисков
 - б) методы диверсификации рисков
 - в) методы компенсации рисков
 - г) методы локализации рисков
18. Соответствие метода управления рисками содержанию:
- а) методы диверсификации рисков
 - б) методы локализации рисков
 - в) методы компенсации рисков
 - г) методы уклонения от рисков
1. Распределение инвестиций в разных отраслях и сферах деятельности
2. Создание специальных инновационных подразделений
3. Увольнение некомпетентных сотрудников
4. Создание системы резервов

3.5 Перечень теоретических вопросов к зачету (для оценки знаний)

Раздел 1. Сущность и основы управления рыночными рисками

1. Рыночный риск и деятельность организации
2. Носители владельцы рыночных рисков
3. Факторы рыночных рисков в деятельности организации
4. Источники рыночных рисков в деятельности организации
5. Угроза как источник потенциально рискованных ситуаций в деятельности организации
6. Банкротство организации как последствия реализации рыночных рисков
7. Анализ внешней среды организации в рискованных ситуациях
8. Анализ внутренней среды организации в рискованных ситуациях
9. Этапы управления рыночными рисками
10. Уровни управления рыночными рисками

Раздел 2. Процесс управления рыночными рисками

11. Процесс идентификации рыночных рисков
12. Описание рыночных рисков
13. Источники и факторы рыночных рисков
14. Информация, необходимая для идентификации рыночных рисков
15. Этапы идентификации рыночных рисков

16. Оценка и анализ рыночных рисков
17. Информация, используемая для оценки и анализа рыночных рисков
18. Структурные характеристики рыночных рисков
19. Экспертный подход к оценке рыночных рисков
20. Метод Дельфи в оценке рыночных рисков
21. Карта рыночных рисков
22. Составляющие риска, необходимые для построения карты рыночных рисков
23. Этапы составления карты рыночных рисков
24. Причины корректировки карты рыночных рисков
25. Этапы корректировки карты рыночных рисков
26. Назначение карты рыночных рисков
27. Методы управления рыночными рисками
28. Метод отказа
29. Метод принятия
30. Метод снижения
31. Метод передачи
32. Способы управления методом отказа
33. Способы управления методом принятия
34. Способы управления методом снижения
35. Способы управления методом передачи
36. Обоснование выбора метода и способа управления рисками
37. Определение эффективности методов и способов управления рыночными рисками
38. Корректировка процесса управления рисками в условиях изменяющейся среды
39. Контроль процесса управления рыночными рисками
40. Мониторинг процесса управления рыночными рисками

3.6 Перечень типовых простых практических заданий к зачету (для оценки умений)

1 Недостаток информации о развитии общества относится к

- А) экономической неопределенности
- Б) социальной неопределенности
- В) политической неопределенности

2 Для оценки рисков деятельности организации подходит

- А) коэффициентный анализ
- Б) вертикальный анализ
- В) горизонтальный анализ

3 Возможность управления рисками организации существует

- А) при любых видах неопределенности
- Б) только в случае экономической неопределенности
- В) в случае отсутствия неопределенности
- Г) в случае политической неопределенности

4 Управление рисками организации влечет за собой

- А) стабильность во внешней среде
- Б) стабильность деятельности организации
- В) не имеет последствий

5 Источником рыночного риска является

- А) неопределенность изменения цен на активы и ресурсы
- Б) неопределенность спроса
- В) неопределенность политической обстановки

6 При использовании метода отказа от риска выделяют

- А) закрытие направления деятельности

- Б) ликвидация организации
- В) отказ от проекта
- Г) смена руководства
- Д) изменение вида выпускаемой продукции

7 Какие методы управления рисками существуют:

- А) отказ от риска
- Б) снижение риска
- В) принятие риска
- Г) передача риска
- Д) игнорирование риска
- Е) выведение риска

8 Самострахование как способ управления рисками относится к методу

- А) передачи
- Б) снижения
- В) отказа
- Г) принятия

9 Карта рисков организации составляется на следующем этапе управления рисками

- А) идентификация рисков
- Б) оценка рисков
- В) анализ рисков
- Г) выбор методов управления рисками
- Д) мониторинг рисков

10 К критериям страхуемости рисков относятся

- А) случайных характер рисков
- Б) чистота ущерба
- В) возможность оценки распределения ущербов
- Г) уязвимость риска

11 К видам информации, необходимой для выявления рисков, относятся:

- А) инсайдерская
- Б) статистическая
- В) международная
- Г) аналитическая

12 Является ли социальная напряженность источником рисков организаций

- А) да
- Б) нет

13 Источником какого риска для деятельности организации является международная напряженность

- А) политического
- Б) валютного
- В) технологического

14 Изменение цен на ресурсы напрямую связан с

- А) рыночным риском
- Б) коммерческим риском
- В) финансовым риском

15 Изменение рыночной конъюнктуры влияет на

- А) маркетинговый риск
- Б) коммерческий риск
- В) рыночный риск

(для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1 Определите вероятность реализации кредитного риска. Оборотные активы компании 920 тыс. руб., денежные средства 120 тыс. руб., дебиторская задолженность 450 тыс. руб. Количество предоставленных рассрочек покупателям 101, количество просрочек по оплате 27 и количество невыполнений условий договора 13.

2 Определите уровень валютного риска. Вероятность реализации составляет 0,53. Сумма обязательств в валюте составляет 548 тыс. руб.

3 Определите уровень технико-технологического риска.

Внеоборотные активы компании составляют 3700 тыс. руб. Финансовые вложения 980 тыс. руб. Производственное оборудование 218 тыс. руб. Станки и технологические установки 742 тыс. руб. Нематериальные активы 725 тыс. руб.

Количество технологических операций, выполняемых организацией за отчетный период, составляет 141. Количество сбоев в производственном процессе за отчетный период составляет 43.

4 Рассчитайте вероятность реализации кредитного риска для организации. Оборотные активы – 120 тыс. руб., запасы – 40 тыс. руб., дебиторская задолженность – 50 тыс. руб., просроченная дебиторская задолженность – 10 тыс. руб.

5 Определите максимальный ущерб реализации логистического риска организации. Оборотные активы – 125 тыс. руб., денежные средства – 30 тыс. руб., запасы- 45 тыс. руб., дебиторская задолженность – 50 тыс. руб.

4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

В таблице приведены описания процедур проведения контрольно-оценочных мероприятий и процедур оценивания результатов обучения с помощью оценочных средств в соответствии с рабочей программой дисциплины/практики.

Наименование оценочного средства	Описания процедуры проведения контрольно-оценочного мероприятия и процедуры оценивания результатов обучения
Задания реконструктивного уровня	Выполнение заданий реконструктивного уровня, предусмотренные рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Вариантов заданий по теме не менее пяти. Во время выполнения заданий пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий разрешено. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся: тему, количество заданий и время выполнения заданий
Задания творческого уровня	Выполнение заданий творческого уровня, предусмотренные рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Вариантов заданий по теме не менее пяти. Во время выполнения заданий пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий разрешено. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся: тему, количество заданий и время выполнения заданий
Собеседование	Собеседование проводится на практическом занятии по теме, изученной на лекции. Во время собеседования пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий разрешено.

	Преподаватель на лекции, предшествующей занятию проведения контроля, доводит до обучающихся: тему и примерные вопросы
Тестирование	Тестирования, предусмотренные рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Тестирование проводится с использованием компьютерных технологий. Варианты тестовых заданий формируются случайно из базы ТЗ. Во время выполнения заданий пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий не разрешено

Для организации и проведения промежуточной аттестации (в форме зачета) составляются типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы:

- перечень теоретических вопросов к зачету для оценки знаний;
- перечень типовых простых практических заданий к зачету для оценки умений;
- перечень типовых практических заданий к зачету для оценки навыков и (или) опыта деятельности.

Перечень теоретических вопросов и перечни типовых практических заданий разного уровня сложности к зачету обучающиеся получают в начале семестра через электронную информационно-образовательную среду КриЖТ ИрГУПС (личный кабинет обучающегося).

Описание процедур проведения промежуточной аттестации в форме зачета и оценивания результатов обучения

При проведении промежуточной аттестации в форме зачета преподаватель может воспользоваться результатами текущего контроля успеваемости в течение семестра. Оценочные средства и типовые контрольные задания, используемые при текущем контроле, позволяют оценить знания, умения и владения навыками/опытом деятельности обучающихся при освоении дисциплины. С целью использования результатов текущего контроля успеваемости, преподаватель подсчитывает среднюю оценку уровня сформированности компетенций обучающегося (сумма оценок, полученных обучающимся, делится на число оценок).

Шкала и критерии оценивания уровня сформированности компетенций в результате изучения дисциплины при проведении промежуточной аттестации в форме зачета по результатам текущего контроля (без дополнительного аттестационного испытания)

Средняя оценка уровня сформированности компетенций по результатам текущего контроля	Оценка
Оценка не менее 3,0 и нет ни одной неудовлетворительной оценки по текущему контролю	«зачтено»
Оценка менее 3,0 или получена хотя бы одна неудовлетворительная оценка по текущему контролю	«не зачтено»

Если оценка уровня сформированности компетенций обучающегося не соответствует критериям получения зачета без дополнительного аттестационного испытания, то промежуточная аттестация в форме зачета проводится в форме собеседования по перечню теоретических вопросов и типовых практических задач (при использовании компьютерных технологий).