

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.15.02 Инвестиционные риски организации **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

Формы промежуточной аттестации в семестрах

Часов по учебному плану (УП) – 108

очная форма обучения: экзамен 7,

В том числе в форме практической

очно-заочная форма обучения: экзамен 8

подготовки (ПП) – 4/4

(очная/очно-заочная)

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 форме ПП*	42/4	42/4
– лекции	14	14
– практические (семинарские)	28/4	28/4
Самостоятельная работа	30	30
Экзамен	36	36
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 форме ПП*	34/4	34/4
– лекции	17	17
– практические (семинарские)	17/4	17/4
Самостоятельная работа	47	47
Экзамен	27	27
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. экон. наук, доцент, доцент

О.Ю. Дягель

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 Цели дисциплины	
1	формирование компетенции в области анализа и управления инвестиционными рисками организации
1.2 Задачи дисциплины	
1	сформировать у обучающихся представление о сущности и особенностях инвестиционных рисков организаций
2	сформировать у обучающихся представление о процессе анализа и управлении инвестиционными рисками
1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины	
Профессионально-трудовое воспитание обучающихся	
<p>Цель профессионально-трудового воспитания – 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.</p> <p>Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:</p> <ul style="list-style-type: none"> – 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 	
Научно-образовательное воспитание обучающихся	
<p>Цель научно-образовательного воспитания – создание условий для реализации научно-образовательного потенциала обучающихся в форме наставничества, тьюторства, научного творчества.</p> <p>Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:</p> <ul style="list-style-type: none"> – формирование системного и критического мышления, мотивации к обучению, развитие интереса к творческой научной деятельности; – создание в студенческой среде атмосферы взаимной требовательности к овладению знаниями, умениями и навыками; – популяризация научных знаний среди обучающихся; – содействие повышению привлекательности науки, поддержка научно-технического творчества; – создание условий для получения обучающимися достоверной информации о передовых достижениях и открытиях мировой и отечественной науки, повышения заинтересованности в научных познаниях об устройстве мира и общества; – совершенствование организации и планирования самостоятельной работы обучающихся как образовательной технологии формирования будущего специалиста путем индивидуальной познавательной и исследовательской деятельности 	

2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	
2.1 Требования к предварительной подготовке обучающегося	
1	Б1.В.ДВ.05.01 Правовые основы обеспечения экономической безопасности и правовые риски
2	Б1.В.ДВ.05.02 Организация предупреждения правонарушений в экономической сфере
3	Б1.В.ДВ.02.01 Теория и методология анализа рисков
4	Б1.В.ДВ.02.02 Оценка профиля рисков организации
5	Б1.В.ДВ.03.01 Теневая экономика и экономическая безопасность
6	Б1.В.ДВ.03.02 Теневая экономическая деятельность
7	Б1.В.ДВ.04.01 Национальная и региональная экономическая безопасность
8	Б1.В.ДВ.04.02 Обеспечение экономической безопасности государства
9	Б1.В.ДВ.11.01 Страхование
10	Б1.В.ДВ.11.02 Современные инструменты риск-менеджмента
11	Б1.В.ДВ.10.01 Финансовая безопасность
12	Б1.В.ДВ.10.02 Оценка экономической безопасности
13	Б1.В.ДВ.12.01 Управление рисками
14	Б1.В.ДВ.12.02 Управление рыночными рисками
15	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.08.01 Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов
2	Б1.В.ДВ.08.02 Организация систем обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов
3	Б1.В.ДВ.09.01 Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности
4	Б1.В.ДВ.09.02 Управление рисками операций на финансовом рынке

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-5.2. Способен анализировать риски и выстраивать процесс управления ими в системе экономической безопасности	ПК-5.2.3 Планирует этапы управления различными видами рисков	Знать: сущность и принципы процесса управления рисками инвестиционной деятельности; этапы управления рисками инвестиционной деятельности; принципы координирования процесса управления рисками инвестиционной деятельности в соответствии с особенностями функционирования экономических субъектов
		Уметь: анализировать информацию, необходимую для планирования процесса управления рисками инвестиционной деятельности; рассчитывать показатели деятельности хозяйствующих субъектов, необходимые для планирования процесса управления рисками инвестиционной деятельности; планировать процесс управления рисками инвестиционной деятельности
		Владеть: навыками интерпретации информации, необходимой для планирования процесса управления рисками инвестиционной деятельности; навыками интерпретации показателей деятельности экономических субъектов, необходимые для планирования процесса управления рисками инвестиционной деятельности; навыками планирования процесса управления рисками инвестиционной деятельности
ПК-5.3. Способен аргументировать выбор алгоритмов противодействия рискам и оценивать их последствия в системе обеспечения экономической безопасности	ПК-5.3.2 Аргументирует выбор способов и инструментов управления различными видами рисков	Знать: сущность и виды рисков инвестиционной деятельности; источники и виды информации для анализа рисков инвестиционной деятельности и выбора способов управления ими; методы, способы и инструменты управления рисками инвестиционной деятельности
		Уметь: собирать, систематизировать и анализировать информацию, необходимую для идентификации рисков инвестиционной деятельности; идентифицировать и описывать риски инвестиционной деятельности; оценивать и анализировать риски инвестиционной деятельности для последующего выбора способов и инструментов управления ими
		Владеть: навыками интерпретации результатов оценки и анализа рисков инвестиционной деятельности; навыками выбора наиболее подходящих способов и инструментов управления рисками инвестиционной деятельности; навыками оценки эффективности выбранных способов и инструментов управления рисками инвестиционной деятельности

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ											*Код индикатора достижения компетенции	
Код	Наименование разделов, тем и видов работы	Очная форма				Очно-заочная форма						
		Семестр	Часы			Семестр	Часы					
Лек	Пр		Лаб	СР	Лек		Пр	Лаб	СР			
1.0	Раздел 1. Сущность и виды инвестиционных рисков											
1.1	Инвестиционные риски организации: сущность, виды инвестиционных рисков, причины, источники и факторы	7	2	4		4	8	3	3		8	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2
2.0	Раздел 2. Управление инвестиционными рисками организации											
2.1	Риск и доходность	7	2	6		2	8	2	2		6	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2
2.2	Оценка и анализ инвестиционных рисков	7	4	6		10	8	6	6		13	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2
2.2	Процесс, методы и способы управления инвестиционными рисками	7	6	10/4		14	8	6	6/4		20	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2
	Итого	7	14	28/4		30	8	17	17/4		47	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2
	Промежуточный контроль – экзамен	7	36				8	27				ПК-5.2.3 ПК-5.3.2

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	Балдин К.В.	Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие [Электронный ресурс]: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=573212	Дашков и К°, 2019	100% онлайн
6.1.1.2	Воронцовский А. В.	Управление инвестициями: инвестиции и инвестиционные риски в реальном секторе экономики : учебник и практикум для вузов [Электронный ресурс]: https://urait.ru/bcode/476569	Москва : Издательство Юрайт, 2021	100% онлайн

6.1.2 Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год издания	Кол-во экз. в библиотеке/ 100% онлайн
6.1.2.1	Рыхтикова	Анализ и управление рисками организации : учебное	Москва :	100 % online

	Н.А.	пособие [Электронный ресурс]: https://new.znanium.com/catalog/document?id=330044	ИНФРА-М, 2019	
6.1.2.2	Погодина Т. В.	Инвестиционный менеджмент : учебник и практикум для вузов [Электронный ресурс]: https://urait.ru/bcode/468898	Москва : Издательство Юрайт, 2021	100 % online
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	Дягель О.Ю.	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 требуется			
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	Об инвестиционной деятельности в Российской Федерации, осуществляемой в форме капитальных вложений [Электронный ресурс]: федер. закон от 25.02.99г. № 39-ФЗ ред. от 28.12.2013. – Режим доступа : http://irbis.krsk.irkups.ru/web_ft/index.php?C21COM=S&S21COLORTERMS=1&P21DBN=IBIS&I21DBN=IBIS_FULLTEXT&LNG=&Z21ID=8965&S21FMT=briefHTML_ft&USES21ALL=1&S21ALL=%3C%2E%3E%3D%D0%A4%D0%B5%D0%B4%D0%B5%D1%80%D0%B0%D0%BB%D1%8C%D0%BD%D1%8B%D0%B9%20%D0%B7%D0%B0%D0%BA%D0%BE%D0%BD%2039%2D%D0%A4%D0%97%21%2D498175997%3C%2E%3E&FT_PREFIX=KT=&SEARCH_STRING=&S21STN=1&S21REF=10&S21CNR=5&auto_open=4			

6.4.2	Методические рекомендации по оценке эффективности инвестиционных проектов [Электронный ресурс]: утв. Минэкономки РФ, Минфином РФ, Госстроем РФ 21.06.1999 № ВК 477. – Режим доступа : http://irbis.krsk.irkups.ru/web_ft/index.php?C21COM=S&S21COLORTERMS=1&P21DBN=IBIS&I21DBN=IBIS_FULLTEXT&LNG=&Z21ID=8965&S21FMT=brieffHTML_ft&USES21ALL=1&S21ALL=%3C%2E%3E%3D330%2F%D0%9C%2054%2D033537355%3C%2E%3E&FT_PREFIX=KT=&SEARCH_STRING=&S21STN=1&S21REF=10&S21CNR=5&auto_open=4
-------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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	
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 помечать 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, 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 обучающимися отдельных элементов, связанных с будущей профессиональной деятельностью (аргументирует выбор способов и инструментов управления различными видами рисков; оказание методической помощи и поддержка процесса управления рисками для ответственных за риск сотрудников организации - владельцев риска)</p>
Самостоятельная работа	<p>Обучение по дисциплине «Инвестиционные риски организации» предусматривает активную самостоятельную работу обучающегося. На самостоятельную работу отводится 30 часов по очной форме обучения, 47 час. – по очной-заочной. 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. 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 семестр/8 семестр</p> <p>Самостоятельная работа обучающихся предполагает самостоятельное изучение отдельных тем, дополнительную их подготовку к каждому практическому занятию, текущему контролю знаний, выполнение ИДЗ и должна соответствовать графику изучения программы дисциплины.</p>
<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.</p>	

**Приложение № 1 к рабочей программе
Б1.В.ДВ.15.02 Инвестиционные риски организации**

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

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

Б1.В.ДВ.15.02 Инвестиционные риски организации

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 «Инвестиционные риски организации» участвует в формировании компетенций:

ПК-5.2. Способен анализировать риски и выстраивать процесс управления ими в системе экономической безопасности

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

№	Неделя	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля (понятие/тем/раздел и т.д. дисциплины)	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
1	1-2	Текущий контроль	1.1 Инвестиционные риски организации: сущность, виды инвестиционных рисков, причины, источники и факторы	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Собеседование (устно)
2	3-6	Текущий контроль	2.1 Риск и доходность.	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Задания реконструктивного уровня (письменно)
3	7-9	Текущий контроль	2.2 Оценка и анализ инвестиционных рисков	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Задания реконструктивного уровня (письменно)
4	10-14	Текущий контроль	2.3 Процесс, методы и способы управления инвестиционными рисками	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Собеседование (устно) В рамках ПП: Задания реконструктивного уровня (письменно)
5	15-17	Промежуточная аттестация - экзамен	Темы 1.1-2.3	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Тестирование (компьютерные технологии)

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

**ПП – практическая подготовка.

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	1-3	Текущий контроль	1.1 Инвестиционные риски организации: сущность, виды инвестиционных рисков, причины, источники и факторы	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Собеседование (устно)
2	4-8	Текущий контроль	2.1 Риск и доходность.	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Задания реконструктивного уровня (письменно)
3	9-11	Текущий контроль	2.2 Оценка и анализ инвестиционных рисков	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Задания реконструктивного уровня (письменно)
4	12-17	Текущий контроль	2.3 Процесс, методы и способы управления инвестиционными рисками	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Собеседование (устно) В рамках ПП: Задания реконструктивного уровня (письменно)
5	18-19	Промежуточная аттестация - экзамен	Темы 1.1-2.3	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Тестирование (компьютерные технологии)

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

**ПП – практическая подготовка.

Описание показателей и критериев оценивания компетенций.

Описание шкал оценивания

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.

Для оценивания результатов обучения используется двухбалльная шкала: «зачтено», «не зачтено».

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
2	Задания реконструктивно го уровня	Позволяют 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 типовых заданий
3	Тест	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
4	Экзамен	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	Типовые тестовые задания

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

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

Критерии и шкалы оценивания результатов обучения при проведении текущего контроля успеваемости

Собеседование

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«отлично»	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 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»	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»	При выполнении заданий обучающийся продемонстрировал недостаточный уровень знаний, умений и владения ими при решении задач в рамках усвоенного учебного материала

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

3.1 Типовые вопросы для собеседования

*Типовые вопросы для собеседования
по теме «Инвестиционные риски организации: сущность, виды инвестиционных рисков, причины, источники и факторы»*

- 1 Понятие инвестиционных рисков
- 2 Носители инвестиционных рисков
- 3 Риски портфельного инвестирования
- 4 Риски реального инвестирования
- 5 Риски венчурного инвестирования
- 6 Причины инвестиционных рисков
- 7 Источники инвестиционных рисков
- 8 Факторы инвестиционных рисков

*Типовые вопросы для собеседования
по теме «Процесс, методы и способы управления инвестиционными рисками»*

- 1 Подходы к управлению инвестиционными рисками
- 2 Методы управления инвестиционными рисками
- 3 Способы управления инвестиционными рисками
- 4 Инструменты управления инвестиционными рисками

5 Аргументация выбора способов и инструментов управления инвестиционными рисками

3.2 Типовые 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.

Типовое задание реконструктивного уровня по теме «Риск и доходность»

Задание 1. Оцените доходность портфеля финансовых активов, если доходность актива «А» составляет 20% в год, доходность актива «Б» составляет 18%. Структура портфеля: актив «А» — 47%, актив «Б» — 53%.

Задание 2. Ожидаемая доходность по акциям фирм «Х» и «У» равна $45 + 15\% \pm 4\%$ соответственно. Определить степень риска операций с данными акциями. Согласно значениям стандартных отклонений разброс доходности по акциям фирмы «Х» значительно выше, следовательно, ее акции должны бы быть более рисковыми. Определить коэффициенты вариации.

Задание 3. Среднемесячное стандартное отклонение курсовой стоимости акций ОАО «ХХХ» составляло 7,9%. Управляющий ПИФа купил пакет акций на сумму 100 млн руб. Временной горизонт операции – 1 мес. Исходя из предположения о нормальном распределении цен по акциям, определим максимальный убыток, который может понести фонд в течение планируемого срока проведения операции при уровне достоверности 99%, и величину резерва, достаточного для его покрытия. Выбранному уровню надежности $a = 99\%$ (вероятности 0,99) соответствует значение 2,326 стандартных отклонений. Тогда, исходя из $P(V_t - V_0 < VaR) = a$, $VaR = V_0 \cdot \mu + a \cdot \sigma$, максимальный убыток по операции 20 при заданных условиях с вероятностью, равной 99%, не превысит: $VaR = \dots$

Типовое задание реконструктивного уровня по теме «Оценка и анализ инвестиционных рисков»

Задание 1. Имеются два инвестиционных проекта. Первый с вероятностью 0,6 обеспечивает прибыль 15 млн. руб., но с вероятностью 0,4 можно потерять 5,5 млн. руб. По второму проекту с вероятностью 0,8 можно получить прибыль 10 млн. руб. и с вероятностью 0,2 потерять 6 млн. руб. Какой проект следует выбрать?

Задание 2. При первоначальном анализе предложенных инвестиционных проектов компания отобрала 10 вариантов инвестирования средств, характеристики которых представлены в таблице. Представить информацию о проектах в графическом виде и сделать: а) сравнительные выводы по вариантам инвестиций, б) итоговый вывод о выборе инвестиционного проекта, учитывая личное отношение к риску

	Вариант инвестирования средств									
	А	Б	В	Г	Д	Е	Ж	З	И	К
Средняя прибыль, получаемая от инвестиционного проекта, млн. руб.	75	77	70	73	69	82	84	81	78	78
Среднее квадратичное отклонение прибыли, млн. руб.	0,2	0,4	0,3	0,1	0,4	0,3	0,3	0,2	0,6	0,3

Задание 3. Оцените чувствительность инвестиционного проекта к фактору изменения суммы постоянных затрат (без амортизации) на 10%, учитывая ниже приведенные данные. Ставка дисконтирования 14%. Сумма инвестиций 2300 тыс.руб. Срок полезного использования основного средства 3 года. Ставка налога на прибыль 20%, начисления процентов учредителям нет. Систематизировать выявленные риски и сделать выводы.

Показатели	1	2	3
Выручка	1100	1640	1694
Затраты переменные	200	256	380
Затраты постоянные (без амортизации)	300	300	300

Задание 4. Имеются следующие характеристики портфеля ценных бумаг:

Акции	Общая рыночная стоимость, \$	Бета-коэффициент
А	6 000	1,5
Б	19 000	1,1
В	2 500	1,2
Г	4 000	0,8
Д	3 000	0,0

Доходность безрисковых ценных бумаг равна 12 %, доходность на рынке в среднем – 16 %. Рассчитайте доходность и бета-портфеля.

*Типовое задание реконструктивного уровня
по теме «Процесс, методы и способы управления инвестиционными рисками»*

Задание 1. Инвестор из страны В вложил 800000 денежных единиц А в государственные облигации страны А. Опасаясь возможного падения валюты А, он продал в сентябре при курсе А/В 1,16 фьючерсы на 800000 денежных единиц А с поставкой в декабре по фьючерсной цене 1,14. Определить результаты хеджирования портфеля облигаций, если в декабре цена облигаций со-ставит 810000 денежных единиц А, а курс А/В спот и фьючерсная цена будут соответственно: а) 1,22 и 1,28; б) 2,10 и 1,32.

Задание 2. Предприятие-заемщик заключило договор страхования риска непогашения кредита со страховой компанией. Кредит взят в сумме 34 млн р. под 19,8% годовых с 1.01.2022 по 15.12.2022 г. Погашение кредита и процентов по нему согласно кредитному договору должно осуществляться раз в месяц. Заемщик оказался не в состоянии вернуть последний платеж и проценты по нему. Предел ответственности 70%. Страховой тариф 4,88%. Определите страховую сумму, сумму страховых платежей и потерь по кредитному риску (сумму страхового возмещения в результате наступления страхового случая).

Типовые задачи, выполняемые в рамках практической подготовки

(трудовая функция В/01.6: Выработка мероприятий по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и их экономическая оценка;

трудовая функция В/03.6: Оказание методической помощи и поддержка процесса управления рисками для ответственных за риск сотрудников организации - владельцев риска)

Задание 1. Составить инвестиционный портфель:

Стандартно инвестиционный портфель состоит из трех основных частей: высокорисковые активы (акции); активы со средним уровнем риска (корпоративные облигации); безрисковые активы (государственные облигации и банковские депозиты).

Учитывая особенности развития отечественного финансового рынка, составить инвестиционный портфель.

1 часть инвестиционного портфеля: выбрать 8-10 организаций эмитентов акций, которые в настоящее время являются наиболее выгодными для инвестирования, а также сохранят эти позиции в будущем.

2 часть инвестиционного портфеля: выбрать 4-6 организаций эмитентов облигаций, покупка которых может обеспечить доход.

3 часть инвестиционного портфеля: обосновать или опровергнуть необходимость покупки государственных облигаций (на какой срок) и определить возможные банки, в которых можно было бы открыть депозит.

Оценить уровень составленного инвестиционного портфеля:

- определить потенциальную доходность
- определить уровень риска
- определить уровень диверсификации
- рассчитать коэффициент Шарпа

3.3 Типовые тестовые задания

Компьютерное тестирование обучающихся по дисциплине используется при проведении промежуточного контроля знаний обучающихся.

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 закрытой формы (ТЗ с выбором одного или нескольких правильных ответов);

ОТЗ – тестовое задание открытой формы (с конструируемым ответом: ТЗ с кратким регламентированным ответом (ТЗ дополнения); ТЗ свободного изложения (с развернутым ответом в произвольной форме)).

Структура тестовых материалов по дисциплине «Инвестиционные риски организации»

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД (с соответствующим номером)	Содержательный элемент	Характеристика содержательного элемента	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
ПК-5.2.3 Планирует этапы управления	1.1 Инвестиционные риски организации:	Понятие и виды инвестиционных рисков	Знание	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
		Факторы инвестиционных рисков	Знание	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД (с соответствующим номером)	Содержательный элемент	Характеристика содержательного элемента	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
различными видами рисков ПК-5.3.2 Аргументирует выбор способов и инструментов управления различными видами рисков	сущность, виды инвестиционных рисков, причины, источники и факторы		Знание	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
		Технический анализ	Знание	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
	2.1 Риск и доходность	Фундаментальный анализ	Знание	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
		Оценка доходности	Знание	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
			Действия	4 – ОТЗ 4 – ЗТЗ
	2.2. Оценка и анализ инвестиционных рисков	Принципы оценки и анализа инвестиционных рисков	Знания	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
		Методический инструментарий оценки уровня риска	Знание	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
		Оценка инвестиционных рисков	Знание	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
			Действия	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
			Умения	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
	2.2. Процесс, методы и способы управления инвестиционными рисками	Содержание процесса управления рисками инвестиций	Знание	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
		Методы управления рисками инвестиций	Знание	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
		Оценка эффективности применения методов управления рисками инвестиций	Действия	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
			Умения	8 – ОТЗ 8 – ЗТЗ
Итого				120 – ЗТЗ 120 – ОТЗ

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*

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

Норма времени – 50 мин.

Дополнительное требование – наличие калькулятора.

1 Портфели минимального риска формируются путем требования:

- а) Максимизации риска при условии ограничения на доходность.
- б) Минимизации риска при условии ограничения на доходность.
- в) Максимизации доходности при условии ограничения на риск.
- г) Минимизации доходности при условии ограничения на риск.

2. Показатели оценки риска делятся на группы
- а) средние, статистические, экспертные
 - б) в условиях определённости, в условиях частичной неопределённости, в условиях полной неопределённости
 - в) статистические, экспертные, в условиях частичной неопределённости
 - г) относительные, вероятностные, в условиях определённости

3 Волатильность – это:

- а) постоянство рыночного спроса
- б) изменчивость курсовых разниц и процентных ставок
- в) постоянство курсовых разниц и процентных ставок
- г) изменчивость рыночного спроса

4 Среднемесячное стандартное отклонение курсовой стоимости акций ОАО «XXX» составляло 6,5%. Управляющий ПИФа купил пакет акций на сумму 100 млн руб. Временной горизонт операции – 1 мес. Исходя из предположения о нормальном распределении цен по акциям, определим максимальный убыток, который может понести фонд в течение планируемого срока проведения операции при уровне достоверности 99%, и величину резерва, достаточного для его покрытия. Выбранному уровню надежности $\alpha = 99\%$ (вероятности 0,99) соответствует значение 2,326 стандартных отклонений. Тогда, исходя из $P(V_t - V_0 < VaR) = \alpha$, $VaR = V_0 \times \alpha$, максимальный убыток по операции 20 при заданных условиях с вероятностью, равной 99%, не превысит: $VaR = \dots$

5 По модели CAPM ожидаемая доходность акции составит

Безрисковая ставка доходности составляет 8% годовых, среднерыночная ставка доходности финансовых активов - 15%, бета - коэффициент составляет 2.5

6 Методами анализа инвестиционных рисков являются:

- а) анализ чувствительности;
- б) метод наименьших квадратов
- в) метод Монте-Карло
- г) анализ ритмичности
- д) анализ индекса рентабельности

7 Формула для расчета коэффициента эластичности/чувствительности фактора имеет вид (РП – результативный показатель; Ф – фактор):

- а) $\% \Delta \Phi / \% \Delta РП$
- б) $\% \Delta РП \times \% \Delta \Phi$
- в) $\% \Delta РП / \% \Delta \Phi$

8 Какое из следующих утверждений с точки зрения выбора инвестиций является справедливым?

- а) Чем больше ожидаемый риск, связанный с инвестицией, тем более высокое вознаграждение ожидает инвестор
- б) Чем меньше срок инвестирования, тем более высокое вознаграждение ожидает инвестор
- в) Чем больше срок инвестирования, тем более высокое вознаграждение ожидает инвестор
- г) Чем меньше ожидаемый риск, связанный с инвестицией, тем более высокое вознаграждение ожидает инвестор.

9 Примером покрытия ущерба за счет передачи ответственности на основе договора является:

- а) хеджирование
- б) кэптивные страховые организации
- в) нестраховой пул
- г) самострахование

10 При управлении рисками повсеместно присутствует неопределенная обстановка, которая подразделяется на объективно-неопределенную, субъективно-неопределенную и случайную (комбинированную). Как характеризуется случайная (комбинированная) неопределенность?

- а) обстоятельства и факторы непредсказуемого характера в равной мере играют значительную роль в формировании рисков
- б) обстоятельства и факторы объективного характера играют главенствующую роль в формировании рисков
- в) обстоятельства и факторы субъективного характера играют главенствующую роль в формировании рисков

11 Выберите критерии, которые используются при оценке эффективности мероприятий по управлению рисками:

- а) результативность
- б) эффективность
- в) субъективность
- г) интегрированность

12 Основным индексом Московской биржи является «Индекс ...»

13 Основным индексом Санкт-Петербургской биржи является «Индекс ...»

14 «Агрессивный» портфель предполагает более ... риск.

15 Чем меньше значение показателя $EV/EBITDA$, тем ... прибыли получит инвестор на вложенный капитал

16 Как связаны между собой ожидаемая доходность инвестиционной деятельности, уровень рисков и длительность инвестиций?....

17 Подсчет P/S производится путем деления текущей рыночной цены акций компании на ее годовую

18 Мультипликатор P/BV рассчитывается путем деления рыночной цены акций компании на ее ... стоимость на акцию.

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.

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. 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
Тестирование	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.
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

Для организации и проведения промежуточной аттестации (в форме экзамена) составляются типовые контрольные тестовые задания.

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

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

Промежуточная аттестация в форме экзамена проводится в форме тестирования. Варианты тестовых заданий для проведения экзамена формируются случайно из базы ТЗ. Количество ОТЗ – 9 (50%), ЗТЗ – 9 (50%)

Для ответа на экзаменационный тест обучающемуся отводится время в пределах 50 минут.