ФЕДЕРАЛЬНОЕ АГЕНТСТВО ЖЕЛЕЗНОДОРОЖНОГО ТРАНСПОРТА

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Иркутский государственный университет путей сообщения»
(ФГБОУ ВО ИрГУПС)

УТВЕРЖДЕНА
приказом и.о. ректора
от «07» июня 2021 г. № 79

Б1.В.ДВ.09.02 Управление рисками операций на финансовом рынке

рабочая программа дисциплины

Специальность/направление подготовки – 38.03.01 Экономика
Специализация/профиль – Экономическая безопасность, анализ и управление рисками
Квалификация выпускника – Бакалавр
Форма и срок обучения – очная форма 4 года
Кафедра-разработчик программы – Финансовый и стратегический менеджмент

Общая трудоемкость в з.е. – 7
Часов по учебному плану (УП) – 252
В том числе в форме практической подготовки (ПП) – 8
(очная)

Формы промежуточной аттестации
очная форма обучения:
зачет 7 семестр, экзамен 8 семестр, курсовая работа 8 семестр

Очная форма обучения **Распределение часов дисциплины по семестрам**

Семестр	7	8	**Итого**
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП	**Часов по УП**
Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*	42/4	36/4	**78/8**
– лекции	14	12	**26**
– практические (семинарские)	28/4	24/4	**52/8**
– лабораторные			
Самостоятельная работа	66	72	**138**
Экзамен		36	**36**
Итого	108/4	144/4	**252/8**

* В форме ПП – в форме практической подготовки.

ИРКУТСК

Электронный документ выгружен из ЕИС ФГБОУ ВО ИрГУПС и соответствует оригиналу
Подписант ФГБОУ ВО ИрГУПС Трофимов Ю.А.
00920FD815CE68F8C4CA795540563D259C с 07.02.2024 05:46 по 02.05.2025 05:46 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 Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 12.08.2020 № 954.

Программу составил(и):
к.э.н., доцент, С.А. Головань,

Рабочая программа рассмотрена и одобрена для использования в учебном процессе на заседании кафедры «Финансовый и стратегический менеджмент», протокол от «4» июня 2021 г. № 11

Зав. кафедрой, к. э. н., доцент С.А. Халетская

1 ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ	
1.1 Цели дисциплины	
1	формирование у обучающихся теоретических знаний по управлению рисками операций на финансовом рынке
2	подготовка обучающихся к активной практической деятельности в области организации управления рисками операций на финансовом рынке
1.2 Задачи дисциплины	
1	получить полное исчерпывающее представление о разнообразии рисков, возникающих при осуществлении операций на финансовом рынке
2	изучить применение комплекса практических показателей, позволяющих судить о степени рискованности операций, осуществляемых на финансовом рынке
1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины	
Научно-образовательное воспитание обучающихся	
Цель научно-образовательного воспитания – создание условий для реализации научно-образовательного потенциала обучающихся в форме наставничества, тьюторства, научного творчества. Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач: – 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	
Профессионально-трудовое воспитание обучающихся	
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. 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	
Блок/часть ОПОП	Блок 1. Дисциплины / Часть, формируемая участниками образовательных отношений
2.1 Дисциплины и практики, на которых основывается изучение данной дисциплины	
1	Б1.В.ДВ.02.01 Теория и методология анализа рисков
2	Б1.В.ДВ.03.01 Теневая экономика и экономическая безопасность
3	Б1.В.ДВ.04.01 Национальная и региональная экономическая безопасность
4	Б1.В.ДВ.05.01 Правовые основы обеспечения экономической безопасности и правовые риски
5	Б1.В.ДВ.07.01 Обеспечение экономической безопасности в транспортной отрасли
6	Б1.В.ДВ.10.01 Финансовая безопасность
7	Б1.В.ДВ.11.01 Страхование
8	Б1.В.ДВ.12.01 Управление рисками
9	Б1.В.ДВ.14.01 Бизнес-планирование
10	Б1.В.ДВ.15.01 Управление рисками инвестиционной деятельности
11	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.09.01 Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности
3	Б2.О.04(Пд) Производственная - преддипломная практика
4	Б3.01(Д) Подготовка к процедуре защиты выпускной квалификационной работы
5	Б3.02(Д) Защита выпускной квалификационной работы

3 ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫОБУЧЕНИЯ 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: правила применения методов, способов и инструментов управления рисками на финансовых рынках; инструменты и критерии оценки финансовых рисков; принципы организации процесса управления рисками на финансовых рынках
		Уметь: интерпретировать информацию для выбора методов, способов и инструментов управления рисками на финансовых рынках; определять выбор направлений оценки рисков на финансовых рынках; организовывать процесс управления рисками на финансовых рынках
		Владеть: навыками анализа рисков на финансовых рынках для обоснования стратегии управления рисками; навыками методов построения «карты рисков» на финансовых рынках; навыками оценки эффективности применяемых инструментов управления
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: задачи и принципы разработки системы управления рисками на финансовых рынках; инструменты и методы управления рисками на финансовых рынках
		Уметь: классифицировать риски на финансовых рынках, выявлять особенности их возникновения и управления в практике предприятий; проводить выбор между способами минимизации финансовых рисков, осуществлять соответствующие расчеты
		Владеть: аналитическими приемами определения целесообразности принятия решений в области управления рисками на финансовых рынках; навыками оценки результативности принятых управленческих решений

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма					*Код индикатора достижения компетенции
		Семестр	Часы				
			Лек	Пр	Лаб	СР	
1.0	**Раздел 1. Особенности управления рисками на финансовых рынках.**						
1.1	Общая характеристика финансовых рынков и финансовых операций	7	1	2		25	ПК-5.2.3
1.2	Взаимодействие участников финансового рынка	7	1	2		10	ПК-5.2.3
2.0	**Раздел 2. Управление отдельными операциями на финансовом рынке.**						
2.1	Общая характеристика кредитного рынка	7	2	4		5	ПК-5.2.3
2.2	Операции на кредитном рынке.	7	2	4/4		5	ПК-5.2.3
2.3	Операции на валютном рынке	7	2	4		5	ПК-5.2.3
2.4	Операции на страховом рынке	7	2	4		5	ПК-5.2.3
2.5	Общая характеристика фондового рынка.	7	2	4		8	ПК-5.2.3
2.6	Операции на фондовом рынке	7	2	4		3	ПК-5.2.3
	Форма промежуточной аттестации – зачет	7					ПК-5.2.3
3.0	**Раздел 3. Идентификация рисков на финансовом рынке.**						
3.1	Количественный и качественный анализ рисков на финансовом рынке	8	6	12/4		30	ПК-5.3.2
3.2	Построение системы управления рисками на финансовом рынке	8	6	12		42	ПК-5.3.2
	Форма промежуточной аттестации – экзамен	8	36				ПК-5.2.3 ПК-5.3.2

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма					*Код индикатора достижения компетенции
		Семестр	Часы				
			Лек	Пр	Лаб	СР	
	Итого часов (без учёта часов на промежуточную аттестацию)		26	52/8		138	

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 Университета, доступной обучающемуся через его личный кабинет

6 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1 Учебная литература

6.1.1 Основная литература

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.1.1	Управление рисками и страхование: теория и практикум : учебное пособие. — Сыктывкар : СГУ им. Питирима Сорокина, 2020. — 120 с. — URL: https://e.lanbook.com/book/290240 (дата обращения: 15.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн
6.1.1.2	Курилова, А. А. Финансовый риск-менеджмент : электронное учебное пособие / А. А. Курилова, К. Ю. Курилов. — Тольятти : ТГУ, 2017. — 203 с. — URL: https://e.lanbook.com/book/139624 (дата обращения: 15.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн

6.1.2 Дополнительная литература

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.2.1	Латышева, Л. А. Финансовый риск-менеджмент : учебник / Л. А. Латышева, Ю. М. Склярова, И. Ю. Скляров ; под общ. ред. Л. А. Латышева. — Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет (СтГАУ), 2021. — 377 с. — URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=700776 (дата обращения: 18.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн
6.1.2.2	Авдийский, В. И. Организация предупреждения правонарушений в сфере экономики : учебник для бакалавров / В. И. Авдийский, Ю. В. Трунцевский, А. В. Петренко, И. Л. Трунов ; под общей редакцией Ю. В. Трунцевского. — Москва : Юрайт, 2022. — 272 с. — URL: https://urait.ru/bcode/508910 (дата обращения: 22.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн

6.1.3 Учебно-методические разработки (в т. ч. для самостоятельной работы обучающихся)

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/ онлайн
6.1.3.1	Головань, С.А. Методические указания по изучению дисциплины Б1.В.ДВ.09.02 Управление рисками операций на финансовом рынке по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профиль Экономическая безопасность, анализ и управление рисками/ С.А. Головань ; ИрГУПС. – Иркутск : ИрГУПС, 2023. – 15 с. - Текст: электронный. - URL: https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_1984_1497_2021_1_signed.pdf	Онлайн

6.2 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

6.2.1	Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» — https://cyberleninka.ru/
6.2.2	Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU — https://elibrary.ru/
6.2.3	Электронно-библиотечная система «Издательство Лань», https://e.lanbook.com/

6.3 Программное обеспечение и информационные справочные системы

6.3.1 Базовое программное обеспечение

6.3.1.1	Microsoft Windows Professional 10, государственный контракт от 20.07.2021 № 0334100010021000013-01

6.3.1.2	Microsoft Office Russian 2010, государственный контракт от 20.07.2021 № 0334100010021000013-01
6.3.1.3	FoxitReader, свободно распространяемое программное обеспечение http://free-software.com.ua/pdf-viewer/foxit-reader/
6.3.1.4	Adobe Acrobat Reader DC свободно распространяемое программное обеспечение https://get.adobe.com/ru/reader/enterprise/
6.3.1.5	Яндекс. Браузер. Прикладное программное обеспечение общего назначения, Офисные приложения, лицензия – свободно распространяемое программное обеспечение по лицензии BSD License
6.3.2 Специализированное программное обеспечение	
6.3.2.1	Не предусмотрено
6.3.3 Информационные справочные системы	
6.3.3.1	Не предусмотрены
6.4 Правовые и нормативные документы	
6.4.1	Не предусмотрены

7 ОПИСАНИЕ МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЙ БАЗЫ, НЕОБХОДИМОЙ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ

1	Корпуса А, Б, В, Г, Д, Е ИрГУПС находятся по адресу г. Иркутск, ул. Чернышевского, д. 15; корпус Л ИрГУПС находится – по адресу г. Иркутск, ул. Лермонтова, д.80
2	Учебная аудитория Л-307 для проведения лекционных и практических занятий, лабораторных работ, групповых и индивидуальных консультаций, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), текущего контроля и промежуточной аттестации. Основное оборудование: : специализированная мебель, мультимедиапроектор, экран, компьютер. Для проведения занятий имеются учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты).
3	Учебная аудитория Л-210 для проведения лекционных и практических занятий, лабораторных работ, групповых и индивидуальных консультаций, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), текущего контроля и промежуточной аттестации. Основное оборудование: специализированная мебель
4	Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, подключенной к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду ИрГУПС. Помещения для самостоятельной работы обучающихся: – читальные залы; – учебные залы вычислительной техники А-401, А-509, А-513, А-516, Д-501, Д-503, Д-505, Д-507; – помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования – А-521

8 МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Вид учебной деятельности	Организация учебной деятельности обучающегося
Лекция	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. 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. 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 лекции. К каждому занятию 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. 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 удается разобраться в материале, то необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации, на практическом занятии

Практическое занятие	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. 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
Самостоятельная работа	Обучение по дисциплине «Управление рисками операций на финансовом рынке» предусматривает активную самостоятельную работу обучающегося. 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) и других видов работ, предусмотренных рабочей программой дисциплины. 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 удается, то в обязательном порядке необходимо посетить консультацию преподавателя, ведущего практические занятия, и/или консультацию лектора. Домашние задания, индивидуальные домашние задания и другие работы, предусмотренные рабочей программой дисциплины должны быть выполнены обучающимся в установленные преподавателем сроки в соответствии с требованиями к оформлению текстовой и графической документации, сформулированным в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль»
Комплекс учебно-методических материалов по всем видам учебной деятельности, предусмотренным рабочей программой дисциплины (модуля), размещен в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет	

Приложение № 1 к рабочей программе

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

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 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 рисками операций на финансовом рынке» 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

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
7 семестр				
1.0	**Раздел 1. Особенности управления рисками на финансовых рынках**			
1.1	Текущий контроль	Общая характеристика финансовых рынков и финансовых операций	ПК-5.2.3	Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Взаимодействие участников финансового рынка	ПК-5.2.3	Собеседование (устно)
2.0	**Раздел 2. Управление отдельными операциями на финансовом рынке**			
2.1	Текущий контроль	Общая характеристика кредитного рынка	ПК-5.2.3	Собеседование (устно)
2.2	Текущий контроль	Операции на кредитном рынке.	ПК-5.2.3	Разноуровневые задачи (задания/письменно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.3	Текущий контроль	Операции на валютном рынке	ПК-5.2.3	Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.4	Текущий контроль	Операции на страховом рынке	ПК-5.2.3	Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.5	Текущий контроль	Общая характеристика фондового рынка.	ПК-5.2.3	Собеседование (устно)
2.6	Текущий контроль	Операции на фондовом рынке	ПК-5.2.3	Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Особенности управления рисками на финансовых рынках Раздел 2. Управление отдельными операциями на финансовом рынке	ПК-5.2.3	Зачет (собеседование) Зачет - тестирование (компьютерные технологии)
8 семестр				
3.0	**Раздел 3. Идентификация рисков на финансовом рынке**			
3.1	Текущий контроль	Количественный и качественный анализ рисков на финансовом рынке	ПК-5.3.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
3.2	Текущий контроль	Построение системы управления рисками на финансовом рынке	ПК-5.3.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Особенности управления рисками на финансовых рынках Раздел 2. Управление отдельными операциями на финансовом рынке	ПК-5.2.3 ПК-5.3.2	Экзамен (собеседование) Экзамен - тестирование (компьютерные технологии)

		Раздел 3. Идентификация рисков на финансовом рынке		

*Форма проведения контрольно-оценочного мероприятия: устно, письменно, компьютерные технологии.
**ПП – практическая подготовка

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 четырехбалльная шкала: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно» и двухбалльная шкала: «зачтено», «не зачтено».

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

Текущий контроль

№	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 для собеседования по темам/разделам дисциплины
2	Разноуровневые задачи (задания)	Различают задачи: – репродуктивного уровня, позволяющие оценивать и диагностировать знание фактического материала (базовые понятия, алгоритмы, факты) и умение правильно использовать специальные термины и понятия, узнавание объектов изучения в рамках определенного раздела дисциплины; может быть использовано для оценки знаний и умений обучающихся; – 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; – 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	Комплект разноуровневых задач и заданий или комплекты задач и заданий определенного уровня

Промежуточная аттестация

№	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в ФОС
1	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 к зачету
2	Тест – промежуточная аттестация в форме зачета	Система автоматизированного контроля освоения компетенций (части компетенций) обучающимся по дисциплине (модулю) с использованием информационно-коммуникационных технологий. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Фонд тестовых заданий
3	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	Перечень теоретических вопросов и практических заданий (образец экзаменационного билета) к экзамену
4	Тест – промежуточная аттестация в форме экзамена	Система автоматизированного контроля освоения компетенций (части компетенций) обучающимся по дисциплине (модулю) с использованием информационно-коммуникационных технологий. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Фонд тестовых заданий

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

Шкалы оценивания		Критерии оценивания	Уровень освоения компетенции
«отлично»	«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
«хорошо»		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
«удовлетворительно»		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	Минимальный

		навыками применения полученных знаний и умений при решении задач в рамках учебного материала. Допустил много неточностей при ответе на дополнительные вопросы	
«неудовлетворительно»	«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

Тест – промежуточная аттестация в форме зачета и экзамена

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
«неудовлетворительно»	«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

Шкалы 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

Разноуровневые задачи (задания)

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Демонстрирует очень высокий/высокий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«хорошо»		Демонстрирует достаточно высокий/выше среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Все требования, предъявляемые к заданию, выполнены
«удовлетворительно»		Демонстрирует средний уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Большинство требований, предъявляемых к заданию, выполнены.

		Демонстрирует низкий/ниже среднего уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Многие требования, предъявляемые к заданию, не выполнены
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Демонстрирует очень низкий уровень знаний, умений, навыков в соответствии с критериями оценивания. Не ответа.

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

3.1 Типовые контрольные задания для проведения собеседования

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

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для проведения собеседований.

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования
«Общая характеристика финансовых рынков и финансовых операций»

1 Финансовые риски в деятельности предприятия
2 Операции на финансовом рынка как источник риска
3 Факторы рисков на финансовых рынках
4 Влияния финансовых операций на устойчивость предприятия
5 Последствия реализаций рисков на финансовых рынках

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования
«Взаимодействие участников финансового рынка»

1 Участники на финансовом рынке
2 Последовательность и взаимосвязь финансовых рынков
3 Идентификация рисков на финансовом рынке
4 Взаимосвязь финансовых рынков как источник риска
5 Интеграция принципов управления рисками на финансовый рынок

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования
«Общая характеристика кредитного рынка»

1 Понятие кредитного рынка
2 Участники на кредитном рынке
3 Финансовые операции на кредитном рынке
4 Роль кредитного рынка в экономике
5 Кредитный рынок как источник риска

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования
«Общая характеристика фондового рынка.»

1 Понятие фондового рынка
2 Участники на фондовом рынке
3 Финансовые операции на фондовом рынке
4 Роль фондового рынка в экономике
5 Фондовый рынок как источник риска

3.2 Типовые контрольные задания для решения разноуровневых задач (заданий)

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

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для решения разноуровневых задач.

Образец заданий для решения разноуровневых задач
«Операции на кредитном рынке.»

Задание: Методические указания по выполнению работы: работа выполняется на примере

конкретного коммерческого банка (необходимо выбрать любой на свое усмотрение).
В работе нужно рассмотреть следующие вопросы (каждый из перечисленных далее вопросов является разделом работы):
1) Выявление кредитных рисков и описание механизма управления им (описать кредитные риски, присущие данному банку. Описать структуры и службы банка ответственные за управление кредитным риском. Дать характеристику нормативным документам Банка России, регламентирующим вопросы управления кредитным риском. Охарактеризовать документы рассматриваемого коммерческого банка, регламентирующие вопросы управления кредитным риском);
2) Провести вертикальный и горизонтальный анализ кредитного портфеля рассматриваемого банка. Рассчитать показатели качества кредитного портфеля.
3) на основании трех предыдущих разделов оценить уровень кредитного риска рассматриваемого банка. Сделать вывод и предложить мероприятия по совершенствованию управления кредитным риском в коммерческом банке.

Образец заданий для решения разноуровневых задач
«Операции на валютном рынке»

Задание: Методические указания по выполнению работы: работа выполняется на примере конкретного коммерческого банка (необходимо выбрать любой на свое усмотрение). По согласованию студента и преподавателя может быть выбрана тема Оценка уровня валютного риска коммерческого банка» или Оценка уровня рыночного риска коммерческого банка».
В работе нужно рассмотреть следующие вопросы (каждый из перечисленных далее вопросов является разделом работы):
1) Выявление процентных рисков и описание механизма управления им (описать процентные риски, присущие данному банку (составить карту рисков, матрицу рисков и т.д.). Описать структуры и службы банка ответственные за управление процентным риском. Дать характеристику нормативным документам Банка России, регламентирующим вопросы управления процентным риском. Охарактеризовать документы рассматриваемого коммерческого банка, регламентирующие вопросы управления процентным риском);
2) Провести анализ депозитной и кредитной политики рассматриваемого банка. Рассчитать процентные доходы и процентные расходы банка, проанализировать процентную маржу.
3) На основании предыдущих разделов оценить уровень процентного риска рассматриваемого банка. Сделать вывод и предложить мероприятия по совершенствованию управления процентным риском в коммерческом банке.

Образец заданий для решения разноуровневых задач
«Операции на страховом рынке»

Задание:
1. Необходимо определить и выработать наиболее эффективную систему минимизации рисков посредством хеджирования фьючерсными контрактами или опционами. Исходные данные: целевая цена производителя сахара, при которой он покрывает свои издержки производства и получает среднюю прибыль, составляет 2678 долл. за 1 тонну, текущая биржевая котировка, по которой можно продать биржевой контракт и заключить опционную сделку, – 2878 долл., а премия (цена опциона) – 100 долл. Предположим, что предприятие находится на реконструкции либо планирует ввести новые мощности, в связи с чем продукция поступит на рынок только через несколько месяцев. К этому времени цены могут понизиться, и предприятие вместо прибыли понесет убытки. Чтобы застраховаться от такого неблагоприятного случая, производитель меди может: 1) продать фьючерсный контракт; 2) продать опцион на покупку; 3) купить опцион на продажу.
Результаты всех операций сведите в таблицу 1, поясните полученные результаты и выберите наиболее эффективный, с Вашей точки зрения, вариант подстраховки.

3.3 Типовые контрольные задания для проведения тестирования

Фонд тестовых заданий по дисциплине содержит тестовые задания, распределенные по разделам и темам, с указанием их количества и типа.

Структура фонда тестовых заданий по дисциплине

Индикатор достижения компетенции	Тема в соответствии с РПД	Характеристика ТЗ	Количество тестовых заданий, типы ТЗ
ПК-5.2.3	Общая характеристика финансовых рынков и финансовых операций	Знание	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Умение	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
ПК-5.2.3	Взаимодействие участников финансового рынка	Знание	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
ПК-5.2.3	Общая характеристика кредитного рынка	Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
ПК-5.2.3	Операции на кредитном рынке.	Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
ПК-5.2.3	Операции на валютном рынке	Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
ПК-5.2.3	Операции на страховом рынке	Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
ПК-5.2.3	Общая характеристика фондового рынка.	Знание	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
ПК-5.2.3	Операции на фондовом рынке	Знание	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
ПК-5.3.2	Количественный и качественный анализ рисков на финансовом рынке	Знание	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ

			5 – ЗТЗ
ПК-5.3.2	Построение системы управления рисками на финансовом рынке	Знание	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Действие	10 – ОТЗ 5 – ЗТЗ
		Итого	Знание

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

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

1. Практика рыночного хозяйствования подсказала необходимость страхования цен, которое производится методом включения в договоры поставки определенных оговорок:

a) Оговорок о форс-мажорных событиях
b) Оговорок о возможности повышения или снижения издержек
c) Оговорок об ответственности контрагентов
d) Оговорок о колебаниях рыночной цены
e) Оговорок о снижении ликвидности

2. Основными элементами управления кредитным риском являются:

a) анализ финансового состояния заемщиков и контрагентов
b) хеджирование
c) обеспечение кредита
d) отказ от проведения операций
e) установка лимитов на операции
f) резервирование

3. К внутренним угрозам предприятия можно отнести (выбрать верное):

a) Отставание технологий предприятия
b) Ошибки персонала
c) Неорганизованность покупателей
d) Промышленный шпионаж
e) Мошенничество персонала
f) Утеря своей ниши на рынке
g) Снижение стоимости акций на рынке
h) Высокие издержки производства

4. Наиболее эффективным со всех точек зрения является предупреждение угроз :

a) В режиме анализа произошедших событий постфактум
b) В режиме контроля текущей деятельности
c) В режиме проведения прогнозных и превентивных мероприятий
d) В режиме подготовки отчетности

5. Риску присущи следующие черты…

6. Прикладное значение классификации рисков заключается в …

7.Рыночные риски можно рассмотреть как группу следующих рисков:

8. Риск изменения корреляционной связи это…

9.Дополните пропущенные уровни обеспечения экономической безопасности предприятия:

1) уровень собственнический (акционерный);
2) *****
3) уровень организационной структуры и системы управления
предприятия, кадровой политики и системы мотивации персонала;
4) *****
5) уровень текущей ФХД в рамках, регламентированных предыдущим уровнем;

6) *****

10.Валовая выручка предприятия в отчетном году 70350 тыс.руб.,в т.ч. от продажи продукции основной деятельности 62715 тыс.руб. Начисления налоговых платежей составили 27790 тыс. руб.,из которых внесено в бюджет 25315 тыс.руб. Каков уровень налогового бремени:

11. Под интегральным риском предприятия понимается:

a) совокупность частных рисков отдельных бизнес-процессов с учетом специфики экономической деятельности предприятия

b) комплекс организационных и практических мер, осуществляемых собственником или менеджером предприятия в целях получения прибыли

c) деятельность управленческого персонала предприятия направленную на максимизацию дохода предприятия с минимальным риском финансовых потерь

d) стратегия удержания большей части предпринимательских рисков внутри компании, принятия на себя новых рисков

12. Налоговая ставка, снижающаяся по мере роста налоговой базы:***

13. Расположите в порядке убывания ликвидности следующие элементы кругооборота текущих активов:

1) Производственно-материальные запас

2)Денежные средства

2) Дебиторская задолженность

3) Готовая продукция

14. В каком случае реинвестирование прибыли способствует росту цены акций фирмы?

15. Рассчитать точку безубыточности и порог безубыточности производства.

Исходные данные:

1. Постоянные затраты на единицу продукции = 150 руб.
2. Переменные затраты на единицу продукции = 250 руб.
3. Рыночная цена = 400 руб.
4. Спрос на продукцию = 1000 шт.
5. Заданная сумма прибыли = 50 тыс. руб.

16. Рассчитайте величину цены капитала фирмы при следующих условиях: общая величина акционерного капитала – 48 млн. руб., нераспределенная прибыль – 1800 тыс. руб., долгосрочные обязательства – 54 млн. руб. При этом доходность акций фирмы составляет 19%, цена нераспределенной прибыли – 34%, а средняя расчетная ставка по долгосрочным обязательствам – 28%.

17. Определите среднюю стоимость заемного капитала – краткосрочного кредита банка (в % к общей сумме кредита), если в течение отчетного года организация трижды использовала кредит:

- сумма кредита 500 тыс. руб. на срок 60 дней с годовой ставкой 50%;
- второй кредит в сумме 300 тыс. руб. на срок 50 дней с годовой ставкой 40%;
- сумма кредита 400 тыс. руб. на срок 80 дней с годовой ставкой 60%.

18. Цены на металлопродукцию за последние 11 месяцев по статистическим данным составили:

Месяц	1	2	3	4	5	6
Цена, долл./т	300	310	312	309	302	305
Месяц	7	8	9	10	11	
Цена, долл./т	304	300	298	305	304	

Какова вероятность того, что в следующем месяце цена уменьшится по сравнению с ее последним значением?

3.4 Перечень теоретических вопросов к зачету

(для оценки знаний)

1) Финансовые риски в деятельности предприятия
2) Операции на финансовом рынка как источник риска

3) Факторы рисков на финансовых рынках
4) Влияния финансовых операций на устойчивость предприятия
5) Последствия реализаций рисков на финансовых рынках
6) Участники на финансовом рынке
7) Последовательность и взаимосвязь финансовых рынков
8) Идентификация рисков на финансовом рынке
9) Взаимосвязь финансовых рынков как источник риска
10) Интеграция принципов управления рисками на финансовый рынок
11) Понятие кредитного рынка
12) Участники на кредитном рынке
13) Финансовые операции на кредитном рынке
14) Роль кредитного рынка в экономике
15) Кредитный рынок как источник риска
16) Сущность управления кредитным риском
17) Способы управления кредитным риском
18) Значение кредитного риска в деятельности предприятия
19) Особенности кредитного риска в финансовом секторе
20) Особенности кредитного риска в нефинансовом секторе
21) Сущность управления валютным риском
22) Способы управления валютным риском
23) Значение валютного риска в деятельности предприятия
24) Объекты валютного риска
25) Влияние сфер деятельности на управление валютным риском
26) Сущность управления риском на страховом рынке
27) Особенности управления риском на страховом рынке
28) Значение операций на страховом рынке в деятельности предприятия
29) Объекты риска на страховом рынке
30) Влияние операций на страховой рынке на систему обеспечения безопасности
31) Понятие фондового рынка
32) Участники на фондовом рынке
33) Финансовые операции на фондовом рынке
34) Роль фондового рынка в экономике
35) Фондовый рынок как источник риска
36) Сущность фондового риска
37) Способы управления риском операций на фондовом рынке
38) Значение фондового риска в деятельности предприятия
39) Фондовый риск в контексте экономических реформ и преобразований
40) Влияние фондового риска на стратегическое финансовое планирование

3.5 Перечень типовых простых практических заданий к зачету

(для оценки умений)

1.Дополните пропущенные уровни обеспечения экономической безопасности предприятия:

1) уровень собственнический (акционерный);
2) *****
3) уровень организационной структуры и системы управления предприятия, кадровой политики и системы мотивации персонала;
4) *****
5) уровень текущей ФХД в рамках, регламентированных предыдущим уровнем;
6) *****

2.В чем выражается субъективная природа риска?

10. В основе предпринимательской деятельности лежит объективная экономическая категория «риск». В экономической теории данное положение выражается графически в

виде зависимости размера получаемой прибыли и уровня риска. Изобразите это на графике.
3. Разработка и внедрение на практике элементов системы минимизации рисков предприятия приводит к существенным выгодам и преимуществам для бизнеса, среди которых можно выделить …- (кратко опишите).

3.6 Перечень типовых практических заданий к зачету

(для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1. Рассчитать точку безубыточности и порог безубыточности производства.
Исходные данные:
1. Постоянные затраты на единицу продукции = 150 руб.
2. Переменные затраты на единицу продукции = 250 руб.
3. Рыночная цена = 400 руб.
4. Спрос на продукцию = 1000 шт.
5. Заданная сумма прибыли = 50 тыс. руб.

2. Рассчитайте величину цены капитала фирмы при следующих условиях: общая величина акционерного капитала – 48 млн. руб., нераспределенная прибыль – 1800 тыс. руб., долгосрочные обязательства – 54 млн. руб. При этом доходность акций фирмы составляет 19%, цена нераспределенной прибыли – 34%, а средняя расчетная ставка по долгосрочным обязательствам – 28%.
3. Определите среднюю стоимость заемного капитала – краткосрочного кредита банка (в % к общей сумме кредита), если в течение отчетного года организация трижды использовала кредит:
- сумма кредита 500 тыс. руб. на срок 60 дней с годовой ставкой 50%;
- второй кредит в сумме 300 тыс. руб. на срок 50 дней с годовой ставкой 40%;
- сумма кредита 400 тыс. руб. на срок 80 дней с годовой ставкой 60%.

4. Цены на металлопродукцию за последние 11 месяцев по статистическим данным составили:

Месяц	1	2	3	4	5	6
Цена, долл./т	300	310	312	309	302	305
Месяц	7	8	9	10	11	
Цена, долл./т	304	300	298	305	304	

Какова вероятность того, что в следующем месяце цена уменьшится по сравнению с ее последним значением?

3.7 Перечень теоретических вопросов к экзамену

(для оценки знаний)

1) Финансовые риски в деятельности предприятия
2) Операции на финансовом рынка как источник риска
3) Факторы рисков на финансовых рынках
4) Влияния финансовых операций на устойчивость предприятия
5) Последствия реализаций рисков на финансовых рынках
6) Участники на финансовом рынке
7) Последовательность и взаимосвязь финансовых рынков
8) Идентификация рисков на финансовом рынке
9) Взаимосвязь финансовых рынков как источник риска
10) Интеграция принципов управления рисками на финансовый рынок
11) Понятие кредитного рынка
12) Участники на кредитном рынке
13) Финансовые операции на кредитном рынке
14) Роль кредитного рынка в экономике
15) Кредитный рынок как источник риска

16) Сущность управления кредитным риском
17) Способы управления кредитным риском
18) Значение кредитного риска в деятельности предприятия
19) Особенности кредитного риска в финансовом секторе
20) Особенности кредитного риска в нефинансовом секторе
21) Сущность управления валютным риском
22) Способы управления валютным риском
23) Значение валютного риска в деятельности предприятия
24) Объекты валютного риска
25) Влияние сфер деятельности на управление валютным риском
26) Сущность управления риском на страховом рынке
27) Особенности управления риском на страховом рынке
28) Значение операций на страховом рынке в деятельности предприятия
29) Объекты риска на страховом рынке
30) Влияние операций на страховой рынке на систему обеспечения безопасности
31) Понятие фондового рынка
32) Участники на фондовом рынке
33) Финансовые операции на фондовом рынке
34) Роль фондового рынка в экономике
35) Фондовый рынок как источник риска
36) Сущность фондового риска
37) Способы управления риском операций на фондовом рынке
38) Значение фондового риска в деятельности предприятия
39) Фондовый риск в контексте экономических реформ и преобразований
40) Влияние фондового риска на стратегическое финансовое планирование
41) Сущность количественного и качественного анализа рисков на финансовом рынке
42) Статистические методы оценки рисков на финансовом рынке
43) Аналитические методы оценки рисков на финансовом рынке
44) Рейтинговые методы оценки рисков на финансовом рынке
45) Экспертные методы оценки рисков на финансовом рынке
46) Понятие системы управления рисками на финансовом рынке
47) Способ построения системы управления в зависимости от вида рисков
48) Элементы системы управления
49) Модели управления рисками на финансовом рынке
50) Подсистемы управления рисками

3.8 Перечень типовых простых практических заданий к экзамену
(для оценки умений)

1.Валовая выручка предприятия в отчетном году 70350 тыс.руб.,в т.ч. от продажи продукции основной деятельности 62715 тыс.руб. Начисления налоговых платежей составили 27790 тыс. руб., из которых внесено в бюджет 25315 тыс.руб. Определите уровень налогового бремени.
2. По данным информационных источников составьте классификацию наиболее часто встречающихся случаев финансового мошенничества.
3. В каком случае реинвестирование прибыли способствует росту цены акций фирмы?

3.9 Перечень типовых практических заданий к экзамену
(для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1. Взрывом разрушен цех, балансовая стоимость которого с учетом износа составляет 100 млн.руб. В цехе находилась продукция стоимостью 20 млн.руб. Для устранения последствий взрыва привлекались люди и техника. Стоимость затрат составила 1 млн. рублей, сумма от сдачи металлолома – 2 млн. Рублей. Восстановительные работы продолжались в течение месяца (цех не работал). Потеря прибыли за этот период – 150 млн. рублей. Затраты на

восстановление цеха – 125 млн. рублей. Определить сумму прямого убытка, косвенного убытка, общую сумму убытка.

2. Вы располагаете следующими видами активов: ГКО, муниципальная облигация, привилегированная акция «Промстройбанка», обыкновенная акция «Иркутскгорстрой», простой вексель «Иркутскмолокозавод». Расположите вышеперечисленные виды активов по мере убывания степени риска.

3. Оборотные активы-20000, Краткосрочные обязательства- 15000, Прибыль до налогообложения- 7000, Ставка налога на прибыль-20%, Собственный капитал- 60000, Заемный капитал- 40 000, Объем продаж- 30000, Суммарные активы-120000.Чему равен индекс кредитоспособности по модели Альтмана?

4. Выберите наименее рисковый вариант вложения, используя коэффициент риска: Проект А: собственные средства = 1000; максимальная сумма убытков равна 400; Проект В: собственные средства = 30000; максимальная сумма убытков равна 12000; Проект С: собственные средства = 50000; максимальная сумма убытков равна 20000.

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
Собеседование	Собеседование, предусмотренное рабочей программой дисциплины, проводится на практическом занятии. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся тему, вопросы для подготовки к собеседованию. Результаты собеседования преподаватель доводит до обучающихся сразу после завершения собеседования
Разноуровневая задача (задание)	Выполнение разноуровневых задач (заданий), предусмотренных рабочей программой дисциплины, проводятся во время практических занятий. Во время выполнения задач (заданий) разрешается пользоваться учебниками, справочниками, конспектами лекций, тетрадями для практических занятий

Для организации и проведения промежуточной аттестации 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 и типовые практические задания разного уровня сложности для проведения промежуточной аттестации обучающиеся получают в начале семестра через электронную информационно-образовательную среду 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. 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	Шкала оценивания
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 проводится в форме собеседования по перечню теоретических вопросов и типовых практических задач или в форме компьютерного тестирования.

Промежуточная аттестация в форме зачета с проведением аттестационного испытания проходит на последнем занятии по дисциплине.

При проведении промежуточной аттестации в форме компьютерного тестирования вариант тестового задания формируется из фонда тестовых заданий по дисциплине случайным

образом, но с условием: 50 % заданий должны быть заданиями открытого типа и 50 % заданий – закрытого типа.

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

Промежуточная аттестация в форме экзамена проводится путем устного собеседования по билетам или в форме компьютерного тестирования.

При проведении промежуточной аттестации в форме собеседования билеты составляются таким образом, чтобы каждый из них включал в себя теоретические вопросы и практические задания.

Билет содержит: два теоретических вопроса для оценки знаний. Теоретические вопросы выбираются из перечня вопросов к экзамену; два практических задания: одно из них для оценки умений (выбирается из перечня типовых простых практических заданий к экзамену); другое практическое задание для оценки навыков и (или) опыта деятельности (выбираются из перечня типовых практических заданий к экзамену).

Распределение теоретических вопросов и практических заданий по экзаменационным билетам находится в закрытом для обучающихся доступе. Разработанный комплект билетов (25-30 билетов) не выставляется в электронную информационно-образовательную среду ИрГУПС, а хранится на кафедре-разработчике фондов оценочных средств.

На экзамене обучающийся берет билет, для подготовки ответа на экзаменационный билет обучающемуся отводится время в пределах 45 минут. В процессе ответа обучающегося на вопросы и задания билета, преподаватель может задавать дополнительные вопросы.

Каждый вопрос/задание билета оценивается по четырехбалльной системе, а далее вычисляется среднее арифметическое оценок, полученных за каждый вопрос/задание. Среднее арифметическое оценок округляется до целого по правилам округления

При проведении промежуточной аттестации в форме компьютерного тестирования вариант тестового задания формируется из фонда тестовых заданий по дисциплине случайным образом, но с условием: 50 % заданий должны быть заданиями открытого типа и 50 % заданий – закрытого типа.

Образец экзаменационного билета

ИРГУПС 20__-20__ учебный год	**Экзаменационный билет № 1** **по дисциплине «<u>Управление рисками операций на финансовом рынке</u>»**	Утверждаю: Заведующий кафедрой «_____» ИрГУПС _____
1 Дайте классификацию кредитного риска, связанного с объектом залога. 2. Составьте классификацию наиболее часто встречающихся случаев финансового мошенничества. 3.Оборотные активы-20000, Краткосрочные обязательства- 15000, Прибыль до налогообложения- 7000, Ставка налога на прибыль-20%, Собственный капитал- 60000, Заемный капитал- 40 000, Объем продаж- 30000, Суммарные активы-120000.Чему равен индекс кредитоспособности по модели Альтмана? 4 Дайте классификацию кредитного риска, связанного с эмитентом облигации.		