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.12.02 Управление рыночными рисками

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. – 3
Часов по учебному плану (УП) – 108
В том числе в форме практической подготовки (ПП) – 4
(очная)

Формы промежуточной аттестации
очная форма обучения:
зачет 7 семестр

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

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

* 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, доцент, Л.С. Бородавко

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 ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ	
1.1 Цель дисциплины	
1	формирование компетенции в области идентификации, оценки и управления рыночными рисками
1.2 Задачи дисциплины	
1	сформировать у обучающихся представление о рыночных рисках
2	сформировать у обучающихся основы применения способов и инструментов управления рыночными рисками

1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины

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.06.01 Методология и практика обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов
3	Б1.В.ДВ.11.01 Страхование
4	Б2.О.03(П) Производственная - технологическая (проектно-технологическая) практика
2.2 Дисциплины и практики, для которых изучение данной дисциплины необходимо как предшествующее	
1	Б1.В.ДВ.09.01 Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности
2	Б1.В.ДВ.13.01 Долгосрочная финансовая стратегия
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-5.1 Способен анализировать и		Знать: основы определения характеристик рыночных рисков, необходимых для составления карты рыночных

интерпретировать информацию о деятельности хозяйствующих субъектов для идентификации угроз и рисков с целью составления и корректировки реестров рисков	ПК-5.1.1 Составляет профиль и карту рисков хозяйствующих субъектов	рисков; принципы и правила составления карты рыночных рисков
		Уметь: составлять карту рыночных рисков; корректировать карту рыночных рисков в соответствии с условиями развития рынков
		Владеть: навыками оценки рыночных рисков и их факторов для составления карты рыночных рисков; навыками оценки результатов разработанной карты рыночных рисков
	ПК-5.1.2 Идентифицирует риски и угрозы в системе экономической безопасности	Знать: природу и источники возникновения рыночных рисков; виды и факторы рыночной неопределенности
		Уметь: собирать, систематизировать и анализировать информацию, необходимую для идентификации рыночных рисков и факторов рыночной неопределенности; идентифицировать и описывать рыночные риски в зависимости от условий функционирования рынков
		Владеть: навыками интерпретации результатов анализа информации, необходимой для идентификации факторов рыночной неопределенности и составления карты рыночных рисков; навыками оценки результатов идентификации рыночных рисков
ПК-5.3 Способен аргументировать выбор алгоритмов противодействия рискам и оценивать их последствия в системе обеспечения экономической безопасности	ПК-5.3.1 Знает и обоснованно применяет методы, способы и инструменты управления рисками	Знать: методы, способы и инструменты управления и нивелирования рыночных рисков; особенности применения инструментов управления рыночными рисками; принципы и особенности функционирования процесса управления рыночными рисками
		Уметь: анализировать информацию для выбора методов, способов и инструментов управления рисками и факторами рыночной неопределенности; обоснованно выбирать методы, способы и инструменты управления рыночными рисками в зависимости от условий функционирования различных видов рынков; планировать процесс нивелирования потенциальных угроз рыночной конъюнктуры
		Владеть: навыками оценки основных параметров рыночных рисков для обоснования инструментов управления ими; навыками формирования мероприятий нивелирования угроз рыночной неопределенности; навыками определения эффективности применяемых инструментов и мероприятий по управлению рыночными рисками

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма					*Код индикатора достижения компетенции
		Семестр	Часы				
			Лек	Пр	Лаб	СР	
1.0	**Раздел 1. Сущность и основы управления рыночными рисками.**						
1.1	Тема 1. Рыночная неопределенность. Особенности возникновения и реализации рыночных рисков	7	3	3		12	ПК-5.1.2
1.2	Тема 2. Этапы и уровни управления рыночными рисками	7	3	3		12	ПК-5.3.1
2.0	**Раздел 2. Процесс управления рыночными рисками.**						
2.1	Тема 3. Идентификация и оценка рыночных рисков. Карта рыночных рисков	7	10	10/2		14	ПК-5.1.1 ПК-5.1.2
2.2	Тема 4. Методы и способы управления рыночными рисками	7	12	12/2		14	ПК-5.3.1
	Форма промежуточной аттестации – зачет	7					ПК-5.1.1 ПК-5.1.2 ПК-5.3.1
	Итого часов (без учёта часов на промежуточную аттестацию)		28	28/4		52	

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	Асламова, В. С. Управление рисками, системный анализ и моделирование : учеб. пособие / В. С. Асламова, Е. А. Руш, Е. А. Асламова. Иркутск : ИрГУПС, 2017. - 176с.	18
6.1.1.2	Балдин, К. В. Управление рисками : учебное пособие / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. — Москва : Юнити-Дана, 2017. — 511 с. — URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=615795 (дата обращения: 18.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн
6.1.1.3	Каранина, Е. В. Финансовая безопасность (на уровне государства, региона, организации, личности) : монография / Е. В. Каранина. — Киров : ВятГУ, 2016. — 240 с. — URL: https://e.lanbook.com/book/201956 (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	Бурцева, Т. А. Моделирование и управление рисками : учебное пособие / Т. А. Бурцева. — Москва : РТУ МИРЭА, 2020. — 131 с. — URL: https://e.lanbook.com/book/171446 (дата обращения: 15.04.2024). — Текст : электронный.	Онлайн
6.1.2.2	Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Юрайт, 2024. — 485 с. — URL: https://urait.ru/bcode/536576 (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	Бородавко, Л.С. Методические указания по изучению дисциплины Б1.В.ДВ.12.02 Управление рыночными рисками по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профиль Экономическая безопасность, анализ и управление рисками / Л.С. Бородавко ; ИрГУПС. – Иркутск : ИрГУПС, 2023. – 12 с. - Текст: электронный. - URL: https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_4474_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 «Образовательная платформа ЮРАЙТ», https://urait.ru/

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-206 для проведения практических занятий, лабораторных работ, групповых и индивидуальных консультаций, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), текущего контроля и промежуточной аттестации. Основное оборудование: специализированная мебель, компьютеры с подключением к сети Интернет, обеспечивающие доступ в электронную информационно-образовательную среду ИрГУПС, учебно-наглядные пособия (презентации, плакаты).
3	Учебная аудитория Л-313 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).
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 рыночными рисками» 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 рыночными рисками» участвует в формировании компетенций:

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

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

Программа контрольно-оценочных мероприятий очная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
7 семестр				
1.0	**Раздел 1. Сущность и основы управления рыночными рисками**			
1.1	Текущий контроль	Тема 1. Рыночная неопределенность. Особенности возникновения и реализации рыночных рисков	ПК-5.1.2	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
1.2	Текущий контроль	Тема 2. Этапы и уровни управления рыночными рисками	ПК-5.3.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
2.0	**Раздел 2. Процесс управления рыночными рисками**			
2.1	Текущий контроль	Тема 3. Идентификация и оценка рыночных рисков. Карта рыночных рисков	ПК-5.1.1 ПК-5.1.2	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.2	Текущий контроль	Тема 4. Методы и способы управления рыночными рисками	ПК-5.3.1	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Сущность и основы управления рыночными рисками Раздел 2. Процесс управления рыночными рисками	ПК-5.1.1 ПК-5.1.2 ПК-5.3.1	Зачет (собеседование) Зачет - тестирование (компьютерные технологии)

*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

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

Шкала оценивания	Критерии оценивания	Уровень

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

Тест – промежуточная аттестация в форме зачета

Шкала оценивания	Критерии оценивания
«зачтено»	Обучающийся верно ответил на 70 % и более тестовых заданий при прохождении тестирования
«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
«Тема 1. Рыночная неопределенность. Особенности возникновения и реализации рыночных рисков»

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

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования
«Тема 2. Этапы и уровни управления рыночными рисками»

1 Сущность процесса управления рыночными рисками
2 Необходимость управления рыночными рисками
3 Этапы процесса управления рыночными рисками
4 Уровни процесса управления рыночными рисками
5 Контроль и мониторинг процесса управления рыночными рисками

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования
«Тема 3. Идентификация и оценка рыночных рисков. Карта рыночных рисков»

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

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования
«Тема 4. Методы и способы управления рыночными рисками»

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

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
«Тема 1. Рыночная неопределенность. Особенности возникновения и реализации рыночных рисков»

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

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

Образец заданий для решения разноуровневых задач
«Тема 2. Этапы и уровни управления рыночными рисками»

Задание:

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

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

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

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

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 3. Идентификация и оценка рыночных рисков. Карта рыночных рисков»

Задание:

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

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

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

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

Для удобства можно воспользоваться аналитической таблицей.

Рыночный риск	Причина	Источники	Факторы
…	…	…	…
…	…	…	…
…	…	…	…

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 4. Методы и способы управления рыночными рисками»

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

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

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

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

4 Составить программу комплексного страхования организации.

5Определить инструменты для хеджирования рыночных рисков

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-5.1.2	Тема 1. Рыночная неопределенность. Особенности возникновения и реализации рыночных рисков	Знание	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-5.3.1	Тема 2. Этапы и уровни управления рыночными рисками	Знание	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-5.1.1 ПК-5.1.2	Тема 3. Идентификация и оценка рыночных рисков. Карта рыночных рисков	Знание	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-5.3.1	Тема 4. Методы и способы управления рыночными рисками	Знание	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	4 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Итого	48 – ОТЗ 36 – ЗТЗ

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.

Образец типового варианта итогового теста,
предусмотренного рабочей программой дисциплины

1. Рыночная неопределенность формируется под влиянием

А – невозможности полного прогнозирования будущих событий

Б – ограниченности информации о развитии рынков

В – нестабильное положение участников рынков

2. Сущность рыночного риска заключается в

А – изменении регулирования рынка

Б – увеличении капитализации рынка

В – изменении цен на различные товары

3. Представьте верный порядок процесса управления рыночными рисками

А – оценка и анализ рыночных рисков

Б – мониторинг процесса управления

В – описание рыночных рисков

Г – выбор метода и способа управления рисками

4. Источником рыночного риска является

А – цена на товар

Б – неопределенность

В – участник рынка

5. Рассчитайте уровень рыночного риска.

В собственности инвестора находится 100 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 315 руб. Волатильность финансового инструмента за период составила 0,0325. Значение нормального стандартного распределения определяется при уровне вероятности в 95%.

6. Рассчитайте уровень рыночного риска с учетом фактора ликвидности.

В собственности инвестора находится 300 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 668 руб. Волатильность финансового инструмента за последний отчетный период составляла 0,0629. Математическое ожидание котируемого спрэда по данному инструменту составляется 0,1321. Значение нормального стандартного распределения определяется для вероятности в 99%.

7. Карта рыночных рисков строится в соответствии с

А – вероятностью и максимальным ущербом

Б – вероятностью и уровнем риска

В – вероятностью и стоимостью товара

8. Соотнесите факторы рыночных рисков и влияние на уровень рыночного риска

А – высокий	1. Умеренный рост инфляции
Б – низкий	2. Резкое увеличение курса национальной валюты
В – средний	3. Использование инструментов хеджирования

9. Прогнозирование факторов рыночной неопределенности осуществляется с целью

А – идентификации возможных факторов рыночных рисков

Б – анализа уровня рыночного риска

В – выбора возможных методов и способов управления рисками

10. Мониторинг процесса управления рыночными рисками заключается в

А – контроле фактических результатов в сравнении с плановыми

Б – сборе и систематизации информации для будущего совершенствования процесса управления

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

А) инсайдерская

Б) статистическая

В) международная

Г) аналитическая

12. Определите уровень риска валютного риска. Вероятность реализации составляет 0,21. Сумма обязательств в валюте составляет 386 тыс. руб. Ответ записать в виде целого числа с двумя знаками после запятой.

13. Наиболее целесообразным способом управления рыночными рисками, относящимся к методу снижения, является *диверсификация*

14. Наиболее целесообразным способом управления рыночными рисками, относящимся к методу передачи, является *хеджирование*

15. Для анализа рыночного риска товара, торгуемого на товарной бирже, используется информация о ценах за какой период времени? *Календарный год*

16. Рассчитайте уровень рыночного риска с учетом фактора ликвидности.

В собственности инвестора находится 250 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 648 руб. Волатильность финансового инструмента за последний отчетный период составляла 0,045629. Математическое ожидание котируемого спрэда по данному инструменту составляется 0,1521. Значение нормального стандартного распределения определяется для вероятности в 95%.

17. Рассчитайте уровень рыночного риска.

В собственности инвестора находится 100 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 395 руб. Волатильность финансового инструмента за период

составила 0,0375. Значение нормального стандартного распределения определяется при уровне вероятности в 99%.

18. Какой способ управления валютным риском, относящийся к методу принятия, является наиболее целесообразным? *Риск-ориентированное бюджетирование*

3.4 Перечень теоретических вопросов к зачету

(для оценки знаний)

1. Рыночный риск и деятельность организации
2. Носители владельцы рыночных рисков
3. Факторы рыночных рисков в деятельности организации
4. Источники рыночных рисков в деятельности организации
5. Угроза как источник потенциально рисковых ситуаций в деятельности организации
6. Банкротство организации как последствия реализации рыночных рисков
7. Анализ внешней среды организации в рисковых ситуациях
8. Анализ внутренней среды организации в рисковых ситуациях
9. Этапы управления рыночными рисками
10. Уровни управления рыночными рисками
11. Процесс идентификации рыночных рисков
12. Описание рыночных рисков
13. Источники и факторы рыночных рисков
14. Информация, необходимая для идентификации рыночных рисков
15. Этапы идентификации рыночных рисков
16. Оценка и анализ рыночных рисков
17. Информация, используемая для оценки и анализа рыночных рисков
18. Структурные характеристики рыночных рисков
19. Экспертный подход к оценке рыночных рисков
20. Метод Дельфи в оценке рыночных рисков
21. Карта рыночных рисков
22. Составляющие риска, необходимые для построения карты рыночных рисков
23. Этапы составления карты рыночных рисков
24. Причины корректировки карты рыночных рисков
25. Этапы корректировки карты рыночных рисков
26. Назначение карты рыночных рисков
27. Методы управления рыночными рисками
28. Метод отказа
29. Метод принятия
30. Метод снижения
31. Метод передачи
32. Способы управления метода отказа
33. Способы управления метода принятия
34. Способы управления метода снижения
35. Способы управления метода передачи
36. Обоснование выбора метода и способа управления рисками
37. Определение эффективности методов и способов управления рыночными рисками
38. Корректировка процесса управления рисками в условиях изменяющейся среды
39. Контроль процесса управления рыночными рисками
40. Мониторинг процесса управления рыночными рисками

3.5 Перечень типовых простых практических заданий к зачету

(для оценки умений)

1 Перечислите этапы управления рыночного рисками. Для каждого этапа представить организационные ресурсы, используемые организацией для реализации.

2 Представьте аспекты изменения внешней среды и уровень неопределенности для каждого уровня управления рыночными рисками.

3 Охарактеризуйте достоинства и недостатки способов передачи рисков как метода управления рыночными рисками. Перечислите возможные последствия их применения для деятельности организации.

3.6 Перечень типовых практических заданий к зачету

(для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1 Рассчитайте котируемый спрэд финансового инструмента, по которому торги характеризуются следующими показателями: цена предложения – 221,24 руб.; цена спроса – 217,34 руб.; минимальная цена - 209,24 руб.; максимальная цена - 239,75 руб.

2 Рассчитайте риск для инвестора с учетом фактора ликвидности при владении финансовым инструментом. В собственности инвестора находится 228 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 463 руб. Волатильность финансового инструмента за последний отчетный период составляла 0,0689. Математическое ожидание котируемого спрэда по данному инструменту составляется 0,1097. Значение нормального стандартного распределения определяется для вероятности в 95%.

3 Рассчитайте риск для инвестора с учетом фактора ликвидности при владении финансовым инструментом. В собственности инвестора находится 200 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 880 руб. Волатильность финансового инструмента за последний отчетный период составляла 0,1365. Математическое ожидание котируемого спрэда по данному инструменту составляется 0,026. Значение нормального стандартного распределения определяется для вероятности в 99%.

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.