

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 «17» июня 2022 г. № 77

Б1.О.54 Управление инвестиционными рисками

рабочая программа дисциплины

Специальность/направление подготовки – 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация/профиль – Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Квалификация выпускника – Экономист
Форма и срок обучения – очная форма 5 лет; заочная форма 6 лет
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) –
4/4
(очная/заочная)

Формы промежуточной аттестации
очная форма обучения:
экзамен 9 семестр
заочная форма обучения:
экзамен 6 курс

Очная форма обучения

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр	9	Итого
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП
Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*	51/4	51/4
– лекции	17	17
– практические (семинарские)	34/4	34/4
– лабораторные		
Самостоятельная работа	21	21
Экзамен	36	36
Итого	108/4	108/4

Заочная форма обучения

Распределение часов дисциплины по семестрам

Курс	6	Итого
Вид занятий	Часов по УП	Часов по УП
Аудиторная контактная работа по видам учебных занятий/ в т.ч. в форме ПП*	12/4	12/4
– лекции	6	6
– практические (семинарские)	6/4	6/4
– лабораторные		
Самостоятельная работа	78	78
Экзамен	18	18
Итого	108/4	108/4

* В форме ПП – в форме практической подготовки.

ИРКУТСК



Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – специалитет по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, утвержденным Приказом Минобрнауки России от 14.04.2021 г. № 293.

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 «17» июня 2022 г. № 10

Зав. кафедрой, к.э.н., доцент

С.А. Халетская

1 ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ	
1.1 Цель дисциплины	
1	формирование компетенции в области оценки и управления инвестиционными рисками хозяйствующих субъектов
1.2 Задачи дисциплины	
1	сформировать представление о сущности и особенностях проявления инвестиционных рисков;
2	сформировать основы владения способами и инструментами управления инвестиционными рисками
1.3 Цель воспитания и задачи воспитательной работы в рамках дисциплины	
Научно-образовательное воспитание обучающихся	
<p>Цель научно-образовательного воспитания – создание условий для реализации научно-образовательного потенциала обучающихся в форме наставничества, тьюторства, научного творчества.</p> <p>Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:</p> <ul style="list-style-type: none"> – формирование системного и критического мышления, мотивации к обучению, развитие интереса к творческой научной деятельности; – создание в студенческой среде атмосферы взаимной требовательности к овладению знаниями, умениями и навыками; – популяризация научных знаний среди обучающихся; – содействие повышению привлекательности науки, поддержка научно-технического творчества; – создание условий для получения обучающимися достоверной информации о передовых достижениях и открытиях мировой и отечественной науки, повышения заинтересованности в научных познаниях об устройстве мира и общества; – совершенствование организации и планирования самостоятельной работы обучающихся как образовательной технологии формирования будущего специалиста путем индивидуальной познавательной и исследовательской деятельности 	
Профессионально-трудовое воспитание обучающихся	
<p>Цель профессионально-трудового воспитания – формирование у обучающихся осознанной профессиональной ориентации, понимания общественного смысла труда и значимости его для себя лично, ответственного, сознательного и творческого отношения к будущей деятельности, профессиональной этики, способности предвидеть изменения, которые могут возникнуть в профессиональной деятельности, и умению работать в изменённых, вновь созданных условиях труда.</p> <p>Цель достигается по мере решения в единстве следующих задач:</p> <ul style="list-style-type: none"> – формирование сознательного отношения к выбранной профессии; – воспитание чести, гордости, любви к профессии, сознательного отношения к профессиональному долгу, понимаемому как личная ответственность и обязанность; – формирование психологии профессионала; – формирование профессиональной культуры, этики профессионального общения; – формирование социальной компетентности и другие задачи, связанные с имиджем профессии и авторитетом транспортной отрасли 	

2 МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП	
Блок/часть ОПОП	Блок 1. Дисциплины / Обязательная часть
2.1 Дисциплины и практики, на которых основывается изучение данной дисциплины	
1	Б1.О.30 Страхование
2	Б1.О.37 Теоретические основы обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов
3	Б1.О.43 Оценка и управление рисками
4	Б1.О.45 Финансовая безопасность
5	Б1.О.49 Система обеспечения экономической безопасности
6	Б1.О.50 Управление финансовыми рисками в системе обеспечения экономической безопасности
7	Б1.В.ДВ.06.01 Экономическая безопасность в цифровой экономике
2.2 Дисциплины и практики, для которых изучение данной дисциплины необходимо как предшествующее	
1	Б2.О.05(П) Производственная - практика по профилю профессиональной деятельности (организационно-управленческая)
2	Б3.01(Д) Подготовка к процедуре защиты выпускной квалификационной работы
3	Б3.02(Д) Защита выпускной квалификационной работы

3 ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ, СООТНЕСЕННЫЕ С ТРЕБОВАНИЯМИ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ		
Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения

ПК-2 Способен при помощи экономических расчетов определять уровень различных видов рисков с целью последующего управления ими	ПК-2.2 Оценивает и анализирует инвестиционные риски действующих субъектов с целью последующего управления ими	Знать: виды рисков инвестиционной деятельности; источники и виды информации, необходимой для оценки инвестиционных рисков для последующего управления ими; подходы к оценке инвестиционных рисков
		Уметь: собирать, систематизировать и анализировать информацию, необходимую для идентификации инвестиционных рисков; идентифицировать и описывать инвестиционные риски; оценивать и анализировать инвестиционные риски для последующего выбора способов и инструментов управления ими
		Владеть: навыками интерпретации информации, необходимой для идентификации и оценки инвестиционных рисков; навыками интерпретации результатов оценки инвестиционных рисков
ПК-6 Способен организовывать процессы управления рисками и нивелирования угроз экономической безопасности с целью внедрения систем управления рисками и обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов	ПК-6.1 Обосновывает выбор способов и инструментов управления различными видами рисков	Знать: принципы управления инвестиционными рисками; источники и виды информации для обоснования способов управления инвестиционными рисками; методы, способы и инструменты управления инвестиционными рисками
		Уметь: собирать, систематизировать и анализировать информацию, необходимую для обоснования способов и инструментов управления инвестиционными рисками; определять особенности деятельности хозяйствующих субъектов, влияющих на управление инвестиционными рисками; обосновывать выбор способов и инструментов управления инвестиционными рисками
		Владеть: навыками интерпретации информации, необходимой для обоснования процесса управления инвестиционными рисками; навыками формирования процесса управления инвестиционными рисками; навыками оценки эффективности выбранных способов и инструментов управления инвестиционными рисками

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма				Заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции		
		Семестр	Часы				Курс	Часы				
			Лек	Пр	Лаб	СР		Лек	Пр		Лаб	СР
1.0	Раздел 1. Теоретические основы инвестиционных рисков.											
1.1	Тема 1. Сущность, особенности и виды инвестиционных рисков	9	2	4	4	6/уст.	1	1		8	ПК-6.1	
1.2	Тема 2. Особенности деятельности различных организаций и их влияние на инвестиционные риски	9	4	8	4	6/уст.				16	ПК-2.2	
2.0	Раздел 2. Управление инвестиционными рисками.											
2.1	Тема 3. Процесс управления инвестиционными рисками	9	2	4	4	6/уст.	1	1		8	ПК-6.1	
2.2	Тема 4. Идентификация и оценка инвестиционных рисков	9	4	8/2	4	6/уст.	2	2/2		14	ПК-2.2	
2.3	Тема 5. Методы и способы управления инвестиционными рисками	9	5	10/2	5	6/уст.	2	2/2		14	ПК-6.1	

4 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Код	Наименование разделов, тем и видов работ	Очная форма				Заочная форма				*Код индикатора достижения компетенции		
		Семестр	Часы				Курс	Часы				
			Лек	Пр	Лаб	СР		Лек	Пр		Лаб	СР
	Форма промежуточной аттестации – экзамен	9	36				6/зимняя	18				ПК-2.2 ПК-6.1
	Контрольная работа						6/зимняя				18	ПК-2.2 ПК-6.1
	Итого часов (без учёта часов на промежуточную аттестацию)		17	34/4		21		6	6/4		78	

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	Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие - 5-е изд., стер. / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов ; рецензенты : Н. Н. Пилипенко, Н. С. Перекалина. Москва : Дашков и К°, 2021. - 418с. - Текст: электронный. - URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=684196	Онлайн
6.1.1.2	Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов - 2-е изд. / А. В. Воронцовский. Москва : Юрайт, 2022. - 485с. - Текст: электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/489580 (дата обращения: 09.09.2022)	Онлайн
6.1.1.3	Ермилова, М. И. Инвестиционная деятельность : учебник / М. И. Ермилова, А. Ф. Лещинская, Н. В. Грызунова, С. В. Лаптев, Е. В. Алтухова. Москва : Юнити-Дана, 2020. - 367с. - Текст: электронный. - URL: https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=692055 (дата обращения: 14.09.2022)	Онлайн

6.1.2 Дополнительная литература

	Библиографическое описание	Кол-во экз. в библиотеке/онлайн
6.1.2.1	Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник / Г. Д. Антонов, О. П. Иванова, В. М. Тумин ; рецензенты : Р. М. Качалов, П. П. Табурчак. Москва : ИНФРА-М, 2020. - 153с. - Текст: электронный. - URL: https://new.znanium.com/catalog/document?id=346774	Онлайн
6.1.2.2	Воронцовский, А. В. Управление инвестициями. Инвестиции и инвестиционные риски в реальном секторе экономики : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. Москва : Юрайт, 2022. - 391с. - Текст: электронный. - URL: https://urait.ru/bcode/496231	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.О.54 Управление инвестиционными рисками по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, специализация Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности / Л.С. Бородавко ; ИрГУПС. – Иркутск : ИрГУПС, 2023. – 13 с. - Текст: электронный. - URL: https://www.irgups.ru/eis/for_site/umkd_files/mu_4478_1562_2022_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-101 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-322 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	<p>Лекция (от латинского «lection» – чтение) – вид аудиторных учебных занятий. Лекция: закладывает основы научных знаний в систематизированной, последовательной, обобщенной форме; раскрывает состояние и перспективы развития соответствующей области науки и техники; концентрирует внимание обучающихся на наиболее сложных, узловых вопросах; стимулирует познавательную активность обучающихся.</p> <p>Во время лекционных занятий обучающийся должен уметь сконцентрировать внимание на изучаемых проблемах и включить в работу все виды памяти: словесную, образную и моторно-двигательную. Для этого весь материал, излагаемый преподавателем, обучающемуся необходимо конспектировать. 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</p>

	<p>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</p>
Практическое занятие	<p>Практическое занятие – вид аудиторных учебных занятий, целенаправленная форма организации учебного процесса, при реализации которой обучающиеся по заданию и под руководством преподавателя выполняют практические задания. Практические задания направлены на углубление научно-теоретических знаний и овладение определенными методами работы, в процессе которых вырабатываются умения и навыки выполнения тех или иных учебных действий в данной сфере науки. Практические занятия развивают научное мышление и речь, позволяют проверить знания обучающихся, выступают как средства оперативной обратной связи; цель практических занятий – углублять, расширять, детализировать знания, полученные на лекции, в обобщенной форме и содействовать выработке навыков профессиональной деятельности.</p> <p>На практических занятиях подробно рассматриваются основные вопросы дисциплины, разбираются основные типы задач. К каждому практическому занятию следует заранее самостоятельно выполнить домашнее задание и выучить лекционный материал к следующей теме. Систематическое выполнение домашних заданий обязательно и является важным фактором, способствующим успешному усвоению дисциплины</p>
Самостоятельная работа	<p>Обучение по дисциплине «Управление инвестиционными 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 удастся, то в обязательном порядке необходимо посетить консультацию преподавателя, ведущего практические занятия, и/или консультацию лектора.</p> <p>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»</p>
<p>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</p>	

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 инвестиционными рисками» участвует в формировании компетенций:

ПК-2. Способен при помощи экономических расчетов определять уровень различных видов рисков с целью последующего управления ими

ПК-6. Способен организовывать процессы управления рисками и нивелирования угроз экономической безопасности с целью внедрения систем управления рисками и обеспечения экономической безопасности хозяйствующих субъектов

Программа контрольно-оценочных мероприятий очная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
9 семестр				
1.0	Раздел 1. Теоретические основы инвестиционных рисков			
1.1	Текущий контроль	Тема 1. Сущность, особенности и виды инвестиционных рисков	ПК-6.1	Собеседование (устно) Творческое задание (письменно)
1.2	Текущий контроль	Тема 2. Особенности деятельности различных организаций и их влияние на инвестиционные риски	ПК-2.2	Собеседование (устно) Творческое задание (письменно)
2.0	Раздел 2. Управление инвестиционными рисками			
2.1	Текущий контроль	Тема 3. Процесс управления инвестиционными рисками	ПК-6.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно) Собеседование (устно)
2.2	Текущий контроль	Тема 4. Идентификация и оценка инвестиционных рисков	ПК-2.2	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.3	Текущий контроль	Тема 5. Методы и способы управления инвестиционными рисками	ПК-6.1	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Теоретические основы инвестиционных рисков Раздел 2. Управление инвестиционными рисками	ПК-2.2 ПК-6.1	Экзамен (собеседование) Экзамен - тестирование (компьютерные технологии)

Программа контрольно-оценочных мероприятий заочная форма обучения

№	Наименование контрольно-оценочного мероприятия	Объект контроля	Код индикатора достижения компетенции	Наименование оценочного средства (форма проведения*)
6 курс, сессия установочная				
1.0	Раздел 1. Теоретические основы инвестиционных рисков.			
1.1	Текущий контроль	Тема 1. Сущность, особенности и виды инвестиционных рисков	ПК-6.1	Собеседование (устно) Творческое задание (письменно)
1.2	Текущий контроль	Тема 2. Особенности деятельности различных организаций и их влияние на инвестиционные риски	ПК-2.2	Конспект (письменно)
2.0	Раздел 2. Управление инвестиционными рисками.			
2.1	Текущий контроль	Тема 3. Процесс управления инвестиционными рисками	ПК-6.1	Разноуровневые задачи (задания/письменно)

				Собеседование (устно)
2.2	Текущий контроль	Тема 4. Идентификация и оценка инвестиционных рисков	ПК-2.2	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
2.3	Текущий контроль	Тема 5. Методы и способы управления инвестиционными рисками	ПК-6.1	Собеседование (устно) В рамках ПП**: Разноуровневые задачи (задания/письменно)
6 курс, сессия зимняя				
	Текущий контроль	Раздел 1. Теоретические основы инвестиционных рисков Раздел 2. Управление инвестиционными рисками	ПК-2.2 ПК-6.1	Контрольная работа (КР) (письменно)
	Промежуточная аттестация	Раздел 1. Теоретические основы инвестиционных рисков Раздел 2. Управление инвестиционными рисками	ПК-2.2 ПК-6.1	Экзамен (собеседование) Экзамен - 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	Контрольная работа (КР)	Средство для проверки умений применять полученные знания по заранее определенной методике для решения задач или заданий по разделу дисциплины. Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся	Типовое задание для выполнения контрольной работы по разделам/темам дисциплины
2	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

3	Разноуровневые задачи (задания)	<p>Различают задачи:</p> <ul style="list-style-type: none"> – 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
4	Конспект	<p>Особый вид текста, в основе которого лежит аналитико-синтетическая переработка информации первоисточника (исходного текста). Цель этой деятельности — выявление, систематизация и обобщение (с возможной критической оценкой) наиболее ценной (для конспектирующего) информации.</p> <p>Может быть использовано для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся</p>	Темы конспектов
5	Творческое задание	<p>Частично регламентированное задание, имеющее нестандартное решение и позволяющее диагностировать умения, интегрировать знания различных областей, аргументировать собственную точку зрения. Может выполняться в индивидуальном порядке или группой обучающихся.</p> <p>Может быть использовано для оценки знаний, навыков и (или) опыта деятельности обучающихся</p>	Темы творческих заданий

Промежуточная аттестация

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

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

Шкала оценивания	Критерии оценивания	Уровень
------------------	---------------------	---------

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

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

Критерии и шкалы оценивания результатов обучения при проведении текущего контроля успеваемости

Контрольная работа

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Обучающийся полностью и правильно выполнил задание контрольной работы. Показал отличные знания и умения в рамках усвоенного учебного материала. Контрольная работа оформлена аккуратно и в соответствии с предъявляемыми требованиями
«хорошо»		Обучающийся выполнил задание контрольной работы с небольшими неточностями. Показал хорошие знания и умения в рамках усвоенного учебного материала. Есть недостатки в оформлении контрольной работы
«удовлетворительно»		Обучающийся выполнил задание контрольной работы с существенными неточностями. Показал удовлетворительные знания и умения в рамках усвоенного учебного материала. Качество оформления контрольной работы имеет недостаточный уровень

«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Обучающийся не полностью выполнил задания контрольной работы, при этом проявил недостаточный уровень знаний и умений
-----------------------	--------------	--

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.

Конспект

Шкалы оценивания		Критерии оценивания
«отлично»	«зачтено»	Конспект по теме выполнен в обозначенный преподавателем срок. Конспект выполнен обучающимся по заданной теме в полном объеме с соблюдением необходимой последовательности. Обучающийся работал полностью самостоятельно; раскрыл тему полностью и ответил на все вопросы преподавателя по конкретной теме конспекта. Конспект оформлен аккуратно, в наиболее оптимальной для фиксации результатов форме
«хорошо»		Конспект по теме выполнен в обозначенный преподавателем срок. Конспект выполнен обучающимся по заданной теме в полном объеме с соблюдением необходимой последовательности. Обучающийся работал полностью самостоятельно; раскрыл тему не полностью и ответил на часть вопросов преподавателя по конкретной теме конспекта. Конспект оформлен аккуратно, с незначительными исправлениями

«удовлетворительно»		Конспект по теме выполнен в обозначенный преподавателем срок. Конспект выполнен обучающимся по заданной теме в не полном объеме с частичным соблюдением необходимой последовательности. Обучающийся работал полностью самостоятельно; раскрыл тему не полностью и ответил на часть вопросов преподавателя по конкретной теме конспекта. Конспект оформлен не аккуратно
«неудовлетворительно»	«не зачтено»	Конспект по теме не выполнен в обозначенный преподавателем срок. Конспект выполнен обучающимся не по заданной теме в не полном объеме без соблюдения необходимой последовательности. Обучающийся работал не самостоятельно; не раскрыл тему и не ответил на вопросы преподавателя по конкретной теме конспекта. Конспект оформлен не аккуратно

Творческое задание

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

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

3.1 Типовые контрольные задания для выполнения контрольных работ

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

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для выполнения контрольных работ.

Образец типового варианта контрольной работы

Контрольная работа выполняется по всем темам дисциплины.

Контрольная работа состоит из трех разделов:

Раздел 1. Краткая характеристика деятельности организации, выбранной для выполнения контрольной работы

Из перечня организаций, предлагаемых для выполнения контрольной работы, обучающийся выбирает объект исследования. В данном разделе приводится общая характеристика деятельности организации. необходимо особое внимание уделить особенностям деятельности, которые во многом определяют перечень и проявление возможных рисков. к таким особенностям относятся: отрасль, виды деятельности, регионы деятельности, организационная структура, финансовые показатели и т.д.

Раздел 2. Оценка и анализ инвестиционных рисков

Оценка рисков реальных инвестиций

Используя данные о деятельности исследуемой организации определить:

- возможное направление реального инвестирования в собственную деятельность (реинвестирования);

- положительные стороны реализации данного направления инвестирования.

В соответствии с выбранным направлением составить типовой инвестиционный проект для исследуемой организации. В инвестиционном проекте должны быть представлены следующие параметры (использовать примерные данные):

- срок реализации проекта;
- сумма необходимых инвестиций;
- годовой доход от реализации инвестиционного проекта;
- текущие расходы на реализацию инвестиционного проекта;
- ставка дисконтирования.

Рассчитать основные параметры инвестиционного проекта:

- чистая приведенная стоимость проекта;
- норма доходности.

Осуществить анализ рисков инвестиционного проекта с использованием метода сценариев развития.

Оценка рисков портфельных инвестиций

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

Учитывая особенности развития отечественного финансового рынка составить инвестиционный портфель.

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

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

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

Оценить уровень составленного инвестиционного портфеля:

- определить потенциальную доходность

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

Раздел 3. Управление инвестиционными рисками

На основании составленных и проанализированных инвестиционных проекта и портфеля представить наиболее оптимальные способы и инструменты управления сопутствующими инвестиционными рисками

3.2 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. Сущность, особенности и виды инвестиционных рисков»

- 1 Понятие инвестиционных рисков
- 2 Носители инвестиционных рисков
- 3 Риски портфельного инвестирования
- 4 Риски реального инвестирования
- 5 Риски венчурного инвестирования

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 2. Особенности деятельности различных организаций и их влияние на инвестиционные риски»

- 1 Причины инвестиционных рисков
- 2 Источники инвестиционных рисков
- 3 Факторы инвестиционных рисков
- 4 Влияние особенностей деятельности организации на инвестиционные риски
- 5 Особенности влияния инвестиционных рисков на деятельность организации

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 3. Процесс управления инвестиционными рисками»

- 1 Этапы управления инвестиционными рисками
- 2 Особенности управления инвестиционными рисками в системе управления рисками организации
- 3 Контроль и мониторинг процесса управления инвестиционными рисками
- 4 Управленческие решения в процессе управления инвестиционными рисками
- 5 Формирование процесса управления инвестиционными рисками с учетом особенностей деятельности организации

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования

«Тема 4. Идентификация и оценка инвестиционных рисков»

- 1 Процесс идентификации инвестиционных рисков
- 2 Анализ внешней среды для идентификации инвестиционных рисков
- 3 Анализ внутренней среды для идентификации инвестиционных рисков
- 4 Описание инвестиционных рисков
- 5 Оформление результатов идентификации инвестиционных рисков
- 6 Подходы к оценке и анализу инвестиционных рисков
- 7 Оценка и анализ рисков реального инвестирования
- 8 Оценка и анализ рисков финансового инвестирования
- 9 Информация, необходимая для оценки и анализа инвестиционных рисков
- 10 Систематизация и анализ информации, необходимой для оценки и анализа инвестиционных рисков

Образец типового варианта вопросов для проведения собеседования
«Тема 5. Методы и способы управления инвестиционными рисками»

- 1 Подходы к управлению инвестиционными рисками
- 2 Методы управления инвестиционными рисками
- 3 Способы управления инвестиционными рисками
- 4 Инструменты управления инвестиционными рисками
- 5 Аргументация выбора способов и инструментов управления инвестиционными рисками

3.3 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 3. Процесс управления инвестиционными рисками»

Задание. На основании финансовой и другой аналитической информации о деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, а также ранее выбранных методов и способов управления рисками инвестиционной деятельности представить возможный процесс управления рисками.

Необходимо:

- представить возможные направления создания организационной структуры процесса управления рисками инвестиционной деятельности организации
- представить функции отдельных сотрудников по управлению рисками инвестиционной деятельности
- представить возможности внедрения процесса управления рисками инвестиционной деятельности в бизнес-процессы осуществления инвестиционной деятельности

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 4. Идентификация и оценка инвестиционных рисков»

Задание. На основании данных о деятельности организации идентифицировать и описать риски инвестиционной деятельности организации. Риски представить с учетом особенностей выбранной организации.

Риск	Информация, необходимая для идентификации	Возможность влияния на деятельность организации	Влияние на деятельность организации
Рыночный риск			
Инфляционный риск			
Технико-технологический риск			
Риск диверсификации			
Риск неисполнения сроков			
Организационно-управленческий риск			
Макроэкономический риск			

Образец заданий для решения разноуровневых задач

«Тема 5. Методы и способы управления инвестиционными рисками»

Задание. На основании данных фондовой биржи осуществить управление рисками инвестиционного портфеля двумя способами: отказа и диверсификации. Сравнение способов осуществлять при помощи коэффициента Шарпа. Данные по ценам акций брать на момент выполнения работы.

Эмитент	Стоимость бумаги	Количество
Газпром		120
Полюс		11
Яндекс		17

ФосАгро		150
Сбербанк		240
НЛМК		45
Русал		31

3.4 Типовые контрольные задания для написания конспекта

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

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для написания конспектов.

Образец тем конспектов

«Тема 2. Особенности деятельности различных организаций и их влияние на инвестиционные риски»

1 Особенности инвестиционной деятельности розничных организаций. Наиболее характерные инвестиционные риски, связанные с направлениями инвестиционной деятельности

2 Особенности инвестиционной деятельности финансовых организаций. Наиболее характерные инвестиционные риски, связанные с направлениями инвестиционной деятельности

3 Особенности инвестиционной деятельности добывающих организаций. Наиболее характерные инвестиционные риски, связанные с направлениями инвестиционной деятельности

4 Особенности инвестиционной деятельности промышленных организаций. Наиболее характерные инвестиционные риски, связанные с направлениями инвестиционной деятельности

5 Особенности инвестиционной деятельности организаций сферы услуг. Наиболее характерные инвестиционные риски, связанные с направлениями инвестиционной деятельности

3.5 Типовые контрольные задания для выполнения творческих заданий

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

Ниже приведен образец типовых вариантов заданий для выполнения творческих заданий.

Образец творческого задания

«Тема 1. Сущность, особенности и виды инвестиционных рисков»

Задание: Учитывая особенности деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, необходимо:

- представить сущность рисков, связанных с инвестиционной деятельностью
- описать влияние этих рисков на деятельность организации

Можно воспользоваться аналитической таблицей

Возможные направления инвестирования	Возможные риски	Сущность рисков	Влияние на деятельность организации
Обновление оборудования			
Модернизация			
Техническое перевооружение			
Получение дополнительного дохода			
Расширение рынка сбыта			
Расширение сети			
Развитие человеческого капитала			
Вложение в нематериальные активы			

Образец творческого задания

«Тема 2. Особенности деятельности различных организаций и их влияние на инвестиционные риски»

Задание: Учитывая особенности деятельности организации, выбранной для выполнения практических работ, а также с учетом различной аналитической информации, представить:

- возможные особенности инвестиционной деятельности организации
- наиболее подходящие виды инвестиций в зависимости от цели организации
- какие особенности будут оказывать влияние на инвестиционные риски

3.6 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-6.1	Тема 1. Сущность, особенности и виды инвестиционных рисков	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-2.2	Тема 2. Особенности деятельности различных организаций и их влияние на инвестиционные риски	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-6.1	Тема 3. Процесс управления инвестиционными рисками	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-2.2	Тема 4. Идентификация и оценка инвестиционных рисков	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
ПК-6.1	Тема 5. Методы и способы управления инвестиционными рисками	Знание	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Умение	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Навык и (или) опыт деятельности/ действие	3 – ОТЗ 3 – ЗТЗ
		Итого	45 – ОТЗ 45 – 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. Инвестиционная деятельность организации нацелена на – получение прибыли

2. Оценить уровень рисков финансовых инвестиций можно оценить при помощи показателя

А – платежи по инвестиционной деятельности

Б – поступления по инвестиционной деятельности

В – *финансовые вложения*

3. Инвестиционные риски организации возникают при

А – совершенствовании имущественного комплекса

Б – оптимизации производства

В – расширении кадрового состава

4. Источником рисков финансового инвестирования организации может являться

А – банкротство контрагента

Б – *инфляция*

В – рост цен на ресурсы

5. Источником технико-технологических рисков при реализации инвестиционного проекта может являться

А – поломка оборудования

Б – рост цены на оборудование

В – увеличение сроков доставки оборудования

6. Источником риска повышения ставки дисконтирования при реализации инвестиционного проекта может являться *рост процентных ставок*

7. Снижение реальных доходов населения может привести к рискам инвестиций *коммерческим*

8. Идентификация риска портфельного инвестирования осуществляется на основании *рыночных данных*

9. Идентификация рисков реального инвестирования осуществляется на основании

А – условий реализации инвестиционного проекта

Б – особенностей деятельности организации

В – регулирования отрасли

10. Идентификация рисков реального инвестирования осуществляется на стадии

А – *прединвестиционной*

Б – инвестиционной

В – эксплуатационной

11. Рассчитайте уровень риска инвестиционного проекта сценарным методом

Чистая приведенная стоимость наиболее вероятного сценария реализации составляет 120 млн. руб. (вероятность 55%). Чистая приведенная стоимость оптимистического сценария реализации составляет 150 млн. руб. (вероятность 10%).

Чистая приведенная стоимость наиболее вероятного сценария реализации составляет 10 млн. руб. (вероятность 35%).

12. Рассчитайте инвестиционный риск финансового инструмента.

Доходность финансового инструмента:

1 период 9,2%;

2 период 7,1%;

3 период 9,2%.

13. Определить риск инвестиционного портфеля.

По данному портфелю имеются следующие данные о предполагаемой доходности с возможной вероятностью:

1. 9,8% с вероятностью 4,5%.

2. 7,0% с вероятностью 6,9%.

3. 1,1%, на данную доходность приходится оставшаяся вероятность.

14. Рассчитайте риск инвестирования методом «стоимость под риском».

В собственности инвестора находится 352 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 834 руб. Волатильность финансового инструмента за период составила 0,0687. Значение нормального стандартного распределения определяется при уровне вероятности в 99%.

15. Рассчитайте риск для инвестора с учетом фактора ликвидности при владении финансовым инструментом.

В собственности инвестора находится 260 шт. Стоимость финансового инструмента в настоящее время составляет 358 руб. Волатильность финансового инструмента за последний отчетный период составляла 0,0951. Математическое ожидание котированного спреда по данному инструменту составляет 0,1344. Значение нормального стандартного распределения определяется для вероятности в 95%.

16. К методам управления инвестиционными рисками организации относятся

А – диверсификация

Б – передачи

В – снижения

Г – финансирования

17. Представьте в верном порядке этапы процесса управления инвестиционными рисками организации

А – оценка и анализ инвестиционных рисков 2

Б – мониторинг результатов управления рисками 4

В – идентификация инвестиционных рисков 1

Г – выбор способов и инструментов управления инвестиционными рисками 3

18. Оценка эффективности процесса управления инвестиционными рисками осуществляется путем

А – расчета финансовых результатов организации

Б – определения эффективности осуществленных затрат на управление инвестиционными рисками

В – анализа динамики основных финансовых показателей организации

3.7 Перечень теоретических вопросов к экзамену

(для оценки знаний)

1. Сущность инвестиций и инвестиционной деятельности
2. Субъекты инвестиционной деятельности
3. Объекты инвестиционной деятельности
4. Инструменты инвестиционной деятельности
5. Виды инвестиций
6. Классификация инвестиций
7. Портфельные инвестиции
8. Реальные инвестиции
9. Венчурные инвестиции
10. Условия осуществления инвестиционной деятельности
11. Регулирование инвестиционной деятельности организаций
12. Особенности инвестиционной деятельности организаций
13. Факторы инвестиционной деятельности организаций
14. Понятие и сущность рисков инвестиционной деятельности организации
15. Причина рисков инвестиционной деятельности организации
16. Источники рисков инвестиционной деятельности организации
17. Факторы рисков инвестиционной деятельности организации
18. Носители рисков инвестиционной деятельности организации
19. Подходы к анализу рисков инвестиционной деятельности
20. Оценка и анализ рисков портфельного инвестирования
21. Оценка и анализ рисков реального инвестирования
22. Оценка и анализ рисков венчурного инвестирования

23. Методы и способы управления рисками инвестиционной деятельности
24. Отказ от рисков инвестиционной деятельности
25. Принятие рисков инвестиционной деятельности
26. Снижение рисков инвестиционной деятельности
27. Передача рисков инвестиционной деятельности
28. Превентивные мероприятия в управлении рисками инвестиционной деятельности
29. Хеджирование как способ управления рисками портфельного инвестирования
30. Процесс управления рисками инвестиционной деятельности
31. Элементы процесса управления рисками инвестиционной деятельности
32. Взаимовлияние элементов процесса управления рисками инвестиционной деятельности
33. Оценка эффективности процесса управления рисками инвестиционной деятельности
34. Показатели оценки эффективности процесса управления рисками инвестиционной деятельности
35. Корректировка процесса управления рисками инвестиционной деятельности

3.8 Перечень типовых простых практических заданий к экзамену

(для оценки умений)

1 Дайте характеристику каждому этапу управления инвестиционными рисками организации. какой из этапов является наиболее важным для управления инвестиционными рисками?

2 Какие особенности деятельности организации влияют на возникновение инвестиционных рисков? Какие условия внешней и внутренней среды могут являться источниками инвестиционных рисков?

3 В чем заключаются организационные особенности процесса управления инвестиционными рисками?

3.9 Перечень типовых практических заданий к экзамену

(для оценки навыков и (или) опыта деятельности)

1 Определите риск реализации инвестиционного проекта при помощи аппарата нечеткой логики. Критерий эффективности инвестиционного проекта составляет 8,3. Исходя из параметров и условий реализации инвестиционного проекта нижняя граница нечеткого числа чистой приведенной стоимости составляет 7,5, среднее значение чистой приведенной стоимости составляет 3,1.

2 Определите риск инвестиционного проекта сценарным подходом. При наиболее вероятном сценарии, вероятность реализации которого составляет 50%, чистая приведенная стоимость составляет 202. При оптимистичном сценарии, вероятность реализации которого составляет 20%, чистая приведенная стоимость составляет 240. При пессимистичном сценарии, вероятность реализации которого составляет 30%, чистая приведенная стоимость составляет 129.

3 Определите риск реализации инвестиционного проекта при помощи аппарата нечеткой логики. Критерий эффективности инвестиционного проекта составляет 132. Исходя из параметров и условий реализации инвестиционного проекта нижняя граница нечеткого числа чистой приведенной стоимости составляет 117, верхняя граница нечеткого числа чистой приведенной стоимости составляет 215, среднее значение чистой приведенной стоимости составляет 170.

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
Контрольная работа	Преподаватель на установочном занятии доводит до обучающихся: темы, количество заданий в контрольной работе. Контрольная работа должна быть выполнена в установленный срок и в соответствии с правилами оформления (текстовой и графической частей), сформулированными в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль» в последней редакции. Выполненная контрольная работа передается для проверки преподавателю в установленные сроки. Если контрольная работа выполнена не в соответствии с указаниями или не в полном объеме, она возвращается на доработку
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
Конспект	Защита конспектов, предусмотренных рабочей программой дисциплины, проводится во время практических занятий. Преподаватель на практическом занятии, предшествующем занятию проведения контроля, доводит до обучающихся: тему конспектов и требования, предъявляемые к их выполнению и защите
Творческое задание	Творческие задания выдаются на практических занятиях, предшествующих изучению предлагаемой темы. Задания выложены в электронной информационно-образовательной среде ИрГУПС, доступной обучающемуся через его личный кабинет. Индивидуальные задания должны быть выполнены в установленный преподавателем срок и в соответствии с требованиями к оформлению (текстовой и графической частей), сформулированными в Положении «Требования к оформлению текстовой и графической документации. Нормоконтроль» (в последней редакции). Выполненные задания в назначенный срок сдаются на проверку

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 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

 <p>ИрГУПС 20__-20__ учебный год</p>	<p>Экзаменационный билет № 1 по дисциплине «<u>Управление инвестиционными рисками</u>»</p>	<p>Утверждаю: Заведующий кафедрой «_____» ИрГУПС _____</p>
<p>1. Понятие и сущность рисков инвестиционной деятельности организации 2. Методы и способы управления рисками инвестиционной деятельности 3. Дайте характеристику каждому этапу управления инвестиционными рисками организации. какой из этапов является наиболее важным для управления инвестиционными рисками? 4. Определите риск инвестиционного проекта сценарным подходом. При наиболее вероятном сценарии, вероятность реализации которого составляет 50%, чистая приведенная стоимость составляет 202. При оптимистичном сценарии, вероятность реализации которого составляет 20%, чистая приведенная стоимость составляет 240. При пессимистичном сценарии, вероятность реализации которого составляет 30%, чистая приведенная стоимость составляет 129.</p>		