МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение

высшего образования

«Воронежский государственный технический университет»

УТВЕРЖДАЮ

Декан факультета Баркалов С.А.

«29» июня 2018 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины

«Риск- менеджмент»

Направление подготовки 38.04.01 ЭКОНОМИКА

Профиль Бухгалтерский учет и аудит

Квалификация выпускника Магистр

Нормативный период обучения 2 года / 2 года и 4 м.

Форма обучения очная / заочная

Год начала подготовки <u>2018</u>

Автор программы

Заведующий кафедрой

Экономики и основ

предпринимательства

Руководитель ОПОП

/Шарапова Е.А./

/Гасилов В.В./

/Дубровская Т.Н./

Воронеж 2018

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Цели дисциплины

Дать представление о современных подходах к построению системы риск —менеджмента на современных предприятиях (организациях), способствовать приобретению навыков в использованию методов управления рисками при решении практических задач.

Предлагаемый курс способствует углубленной трансформации уже полученных экономических знаний, ориентированных, в основном, на детерминированные экономические процессы в направлении осознания роли стохастических факторов в экономической теории и практике.

1.2. Задачи освоения дисциплины

- изучение основных понятий, принципов и базовых концепций риск-менеджмента в современных рыночных условиях;
- изучение современных теорий и моделей риск-менеджмента, используемых в зарубежной и российской практике, и критериев оценки эффективности управленческих решений в области риск-менеджмента;
- изучение способов идентификации рисков, сопутствующих предпринимательской деятельности, определение их качественных и количественных характеристик и управление ими на основе концепции допустимого риска;
- выявление финансовых рисков в общей системе рисков предпринимательской деятельности;
- оценка рыночных, кредитных, операционных рисков и рисков ликвидности в соответствии с существующими статистическими и аналитическими способами анализа и учета неопределенности для данных видов рисков;
- оценка финансовых результатов деятельности экономических субъектов с учетом риска;
- изучение основных факторов финансовых рисков в деятельности, а также стратегических принципов работы экономических субъектов в условиях неопределенности;
- изучение основных видов рисков, возникающих в процессе принятия финансовых решений компаниями;
- разработка стратегии управления финансовыми рисками экономического субъекта;
- оценка инвестиционных рисков и управление ими;
- учет рисков при анализе и подготовке управленческих решений в финансовой сфере организаций.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к дисциплинам вариативной части (дисциплина по выбору) блока Б1.

3. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Процесс изучения дисциплины «Риск-менеджмент» направлен на формирование следующих компетенций:

- ДПК-5 способность систематизировать учетную и внеучетную информацию различных видов с целью формирования системы ключевых по-казателей оценки деятельности организации и ее бизнес-сегментов, умение планирования экономической политики организации, с целью предотвращения отрицательных результатов ее деятельности
- OK-3 готовностью к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала
- ПК-5 способностью самостоятельно осуществлять подготовку заданий и разрабатывать проектные решения с учетом фактора неопределенности, разрабатывать соответствующие методические и нормативные документы, а также предложения и мероприятия по реализации разработанных проектов и программ
- ПК-6 способностью оценивать эффективность проектов с учетом фактора неопределенности
- ПК-8 способностью готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне
- ПК-9 способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов
- ПК-10 способностью составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом
- ДПК-2 способность к использованию баз данных и информационных систем при реализации организационно-управленческих функций
 - ОК-1 способностью к абстрактному мышлению, анализу, синтезу
- OK-2 готовностью действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения

ОПК-3 - способностью принимать организационно-управленческие решения

Компетенция	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции			
ДПК-5	Знать современные концепции бухгалтерского			
	учета и отчетности; совокупность приемов и			
	пособов бухгалтерского учета, анализа, ауди-			
	та;			
	Уметь выстроить иерархическую модель			
	управления финансовой службой с эффектив-			
	ным распределением обязанностей на основе			

	1
	фундаментальных
	знаний и осознания концепций бухгалтерского
	учета
	Владеть практическими навыками распреде-
	ления функций по учету внеоборотных активов,
	производственных запасов, затрат на произ-
	водство
	готовой продукции и товаров, денежных
	средств для формирования системы ключевых
	показателей оценки деятельности организации;
	способами оценки финансовых результатов с
	целью предотвращения отрицательных резуль-
	татов ее деятельности.
ОК-3	Знать принципы планирования личного вре-
	мени, способы и методы саморазвития и само-
	образования
	Уметь самостоятельно овладевать знаниями и
	навыками их применения в профессиональной
	деятельности; оценивать систему финансовых
	рисков в деятельности фирмы; давать пра-
	вильную самооценку, намечать пути и выби-
	рать средства развития достоинств и устране-
	ния недостатков.
	Владеть навыками самостоятельной, творче-
	ской работы, умением организовать свой труд;
	способностью к самоанализу и самоконтролю, к
	самообразованию и самосовершенствованию, к
	поиску и реализации новых, эффективных форм
	организации своей деятельности; навыками
	использования творческого потенциала для
	управления системой рисков на предприятии.
ПК-5	Знать основные источники информации, даю-
11K-3	щие возможность изучать результаты, полу-
	ченные отечественными и зарубежными ис- следователями в избранной области исследо-
	<u> </u>
	ваний.
	Уметь применять базовые микроэкономические
	модели, если это необходимо в избранной об-
	ласти исследований.
	Владеть навыками анализа источников инфор-
	мации, дающих возможность изучать резуль-
	таты, полученные отечественными и зарубеж-
	ными исследователями в
	избранной области исследований.

ПК-6	Знать виды инвестиционных проектов и их
11110	особенности;
	различные критерии оценки эффективности
	инвестиционных проектов; особенности учета
	<u> </u>
	временной ценности денежных ресурсов в ин-
	вестиционных решениях;
	Уметь обосновывать экономическую эффек-
	тивность инвестиционных проектов на основе
	отдельных методов оценки; составить инве-
	стиционный портфель с учетом генерируемой
	доходности и риска;
	Владеть навыками проведения инвестицион-
	ного анализа в условиях неопределенности и
	риска; методикой расчета
	экономических и социально-экономических
	показателей
	оценки эффективности инвестиционных ре-
	шений.
ПК-8	Знать - методы многофакторного стратегиче-
	ского анализа бизнес-среды; основные источ-
	ники информации по проблемам стратегиче-
	ского управления развитием бизнеса.
	Уметь систематизировать наблюдаемые явле-
	ния и процессы на основе методов анализа фи-
	нансовых рисков; находить теоретическое ос-
	нование для объяснения наблюдаемых явлений
	и процессов и выбирать методологию их ис-
	следования.
	Владеть методологическими приемами приня-
	тия стратегических решений на микро- и мак-
	роуровне и оценки альтернатив развития биз-
	неса в условиях рынка
ПК-9	Знать внешние и внутренние источники ин-
	формационных данных, используемых для
	анализа и оценки рисков;
	методы, способы и средства получения ин-
	формации для
	разработки и реализации стратегии оценки
	финансовых рисков.
	Уметь выбрать инструментальные средства для
	обработки экономических информационных
	Данных.
	Владеть методикой анализа данных для прове-
	дения необходимых экономических расчетов;

	VOTO TOLIV OVO TVOO VVID OPVOVVI TTE TE OPOTOVVI
	методами анализа информации для проведения
	расчетов по оценке финансовых рисков; навы-
	ками работы с информацией
	по выявлению и анализу рисков.
ПК-10	Знать методы составления прогноза основных
	социально-экономических показателей дея-
	тельности предприятия, отрасли, региона и
	экономики в
	целом; основные источники информации, ис-
	пользуемые в прогнозировании.
	Уметь систематизировать наблюдаемые явле-
	ния и процессы с целью разработки прогнозов;
	осуществлять эффективный поиск информации
	о состоянии
	организации и результатах ее деятельности;
	использовать методы прогнозирования в про-
	цессе разработки
	стратегий развития бизнеса;
	Владеть методологическими правилами и
	приемами сценарного прогнозирования; мето-
	дами оценки альтернативных прогнозов ос-
	новных социально-экономических показателей
	деятельности предприятия, отрасли, региона и
	экономики в целом.
ДПК-2	Знать нормативно-правовую базу, регламенти-
,	рующую деятельность предприятия в различ-
	ных организационно- правовых формах и сфе-
	рах деятельности.
	Уметь осуществить выбор наиболее эффек-
	тивной организационно-правовой формы
	для минимизации уровня неопределенности.
	Владеть способностью применения баз дан-
	ных и информационных систем при реализации
	организационно-управленческих функций в
	целях анализа финансовых рисков
OK-1	Знать методы анализа и синтеза
OK-1	информации
	Уметь абстрактно мыслить; анализировать и
	обобщать полученную в ходе исследования
	информацию.
	Владеть способностью к абстрактному
OLC 2	мышлению, анализу и синтезу.
OK-2	Знать основные приемы действий в нестан-
	дартных бизнес-ситуациях; содержание соци-

	_
	альной и этической ответственности при при-
	нятии бизнес-решений.
	Уметь действовать в нестандартных ситуациях;
	нести социальную и этическую ответственность
	за принятые
	управленческие решения.
	Владеть методиками и технологиями действий
	в нестандартных бизнес-ситуациях.
ОПК-3	Знать виды управленческих решений и методы
	их принятия; принципы построения организа-
	ционных структур и распределения функций
	управления.
	Уметь организовывать командное взаимодей-
	ствие для решения задач в части анализа и
	управления рисками; воздействовать на персо-
	нал различными методами для достижения це-
	лей организации; разрабатывать и принимать
	оптимальные решения; организовывать их ре-
	ализацию и контроль за исполнением решений;
	управлять работой производственного коллек-
	тива и работать в команде.
	Владеть методами реализации основных
	управленческих функций (принятие решений,
	организация, мотивирование и контроль) в во-
	просах снижения степени неопределенности

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Риск-менеджмент» составляет 4 з.е. Распределение трудоемкости дисциплины по видам занятий

очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего	Семестры
Виды учеоной расоты	часов	3
Аудиторные занятия (всего)	42	42
В том числе:		
Лекции	14	14
Практические занятия (ПЗ)	28	28
Самостоятельная работа	102	102
Курсовая работа	+	+
Часы на контроль		
Виды промежуточной аттестации - зачет с	+	+
оценкой	+	+
Общая трудоемкость:		
академические часы	144	144
зач.ед.	4	4

заочная форма обучения

Drawn variety of referre	Всего	Семестры
Виды учебной работы	часов	4
Аудиторные занятия (всего)	12	12
В том числе:		
Лекции	4	4
Практические занятия (ПЗ)	8	8
Самостоятельная работа	128	128
Курсовая работа	+	+
Часы на контроль	4	4
Виды промежуточной аттестации - зачет с оцен-	1	
кой	+	+
Общая трудоемкость:		
академические часы	144	144
зач.ед.	4	4

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

5.1 Содержание разделов дисциплины и распределение трудоемкости по видам занятий

Дневная форма обучения

№ п/п	Наименование темы	Содержание раздела	Лекц	Прак зан.	CPC	Всего, час
1	Основы теории управления риском	Управление риском как отрасль знания. Логические и исторические предпосылки создания теории управления риском. Роль и место риска, как экономической категории. Сущность риска, основные элементы, причины возникновения. Объекты и субъекты риска. Общая классификация опасностей. Классификация рисков. Критерии классификации (по времени возникновения, по факторам возникновения, по характеру учета, по характеру последствий, по сферевозникновения). Краткая характеристика основных видов риска в различных сферах экономической деятельности Методы управления риском. Основные принципы управления риском (избежание, снижение, принятие, отказ). Этапы процесса управления риском (выявление и оценка, сравнение методов воздействия на риск, выбор методов воздействия. на риск)	2	4	11	17

2	Основы риск-менеджмента.	Окружающая рисковая среда организации. Рисковая микросреда организации. Ценности компании, подверженые риску. Типовые риски, которым подвержена организация. Склонность к риску. Что лежит в основе рискового поведения человека. Психологические факторы, определяющие поведение человека в условиях риска. Опыты Канемана и Тверски. Отношение к риску: позиция компании. Компании лемминг, дронт, страус и сова. Рациональный уровень риска и этап развития организации. Модель управления риском. Основные элементы риск менеджмента. Краеугольные камни риск-менеджмента. Правила управления рисками. Определение рамок рискменеджмента. Определение склонности к риску. Создание культуры риск-менеджмента. Методический арсенал диагностики риска. Выгоды риск-менеджмента	2	4	11	17
3	Методы определения и оценки риска.	Методы диагностики рисков. Источники сбора информации для идентификации рисков. Методический арсенал диагностики рисков. Картографирование рисков фирмы. Учет рисков в экономических решениях фирмы. Особенности идентификации и картографирования рисков для российских компаний. Методы прогнозирования рисков: метод использования аналогов, статистический метод, метод логических построений, математические методы, экспертный метод, натурное моделирование. Построение карты рисков. Различные варианты построения рискографии предприятия. Методы выявления риска. Опросные листы, карты потоков, прямая инспекция, анализ финансовой и управленческой отчетности. Сущность и роль в оценке риска. Оценка вероятности не-	2	6	21	29

		благоприятных событий				
		через сценарный подход. Метод				
		построения деревьев событий.				
		Метод «события-последствия».				
		Метод деревьев отказов. Метод				
		индексов опасности. Статистиче-				
		ские и вероятностные подходы к				
		количественной оценке риска.				
		Дисперсия и вариация как меры				
		риска. Использование распреде-				
		лений Пуассона, Бернулли, Гаус-				
		са, Больцмана для оценки риска.				
4	Организация управления	_				
'						
	рисками					
		Функции управления рисками в				
		деятельности отдельных подраз-				
		делений организации. Функции				
		специализированного органа				
		управления рисками. Меры				
		риск-менеджмента. Структура				
		программы управления рисками.				
		Макет программы управления				
		рисками и ее финансирование.				
		Построение программы				
		Управления рисками. Разработка				
		мер реагирования: избежание,				
		снижение, принятие рисков. Спо-	4	4	16	24
		собы управления рисками: орга-				
		низационный, финансовый, дого-				
		ворной подходы.				
		Финансовый аспект управления				
		рисками: коэффициентный анализ				
		рисковой позиции фирмы.				
		Выработка и принятие решений по				
		стратегии управления рисками.				
		Разработка механизмов миними-				
		зации устранения рисков.				
		Механизм финансирования рис-				
		ков. Дособытийное и послесобы-				
		тийное финансирование. Затраты				
		на риск.				
5	Практика построения систем	Опыт построение интегральной				
	управления	систему управления рисками ме-				
	, i	таллургической компании. Эво-				
		люция системы управления рис-				
		ками. Задачи, решаемые на первом				
		этапе (фрагментарный подход).				
		Задачи, решаемые на втором этапе	2	4	21	27
		(интегральный подход). Политика				
		в области управления рисками.				
		Факторы рисков. Карта рисков.				
		Матрица принятия решений. Ре-				
		гламенты управления рисками.				
		Трехуровневая яистема управле-				
	1	pen_poblicban microma ympablic-				

_						
		ния рисками предприятия. Цели и				
		функции каждого уровня. Эффект				
		от внедрения системы управления				
		рисками.				
		Опыт построения системы управ-				
		ления операционными рисками.				
		Ситуации, показывающая уровень				
		подверженности компании опе-				
		рационными рисками.				
		Требования к системе построения				
		операционных рисков: рисковая				
		модель компании; субъекты				
		управления рисками; регламен-				
		тирующие документы. Реализация				
		системы: описание				
		бинес-процессов и выявление				
		рисков; оценка рисков и отбор				
		значимых рисков; разработка ме-				
		роприятий по управлению рис-				
		ками; внедрение системы управ-				
		ления рисками. Как система реа-				
		гирует на операционные риски.				
6	Типовые решения управления	Производственный риск. Причи-				
	риском в различных	ны возникновения, структура,				
	областях	сущность, методы управления.				
		Организация управления произ-				
		водственным риском. Риски				
		неисполнения хозяйственных до-				
		говоров. Риски усиления конку-				
		ренции. Риски возникновения				
		непредвиденных расходов и со-				
		кращение доходов. Риски потери				
		имущества предпринимательской				
		организации. Риск невостребо-				
		ванности продукции. Промыш-				
		ленная безопасность. Управление				
		рисками в промышленности.				
		Финансовый риск. Причины воз-				
		никновения, сущность, методы	2	6	22	30
		управления. Риски ликвидности в				
		финансовых институтах. Меха-				
		низмы управления ликвидностью.				
		Инвестиционные риски, Бирже-				
		вые риски. Процентные риски.				
		Рыночные рис-				
		ки.Инвестиционный риск. Зако-				
		номерности управления				
		инвестиционными проектами.				
		Структура инвестиционных				
		рисков. Особенность влияния				
		странового риска на деятельность				
		проекта. Технологии учета риска				
		проекта.Проблемы количествен-				
		ной оценки риска проекта.				
		Отражение риска проекта в дис-				

Причины возникновения, о ность, методы управления. Страновой риск. Причины никновения, сущность, методы управления, сущность, методы и причины никновения, сущность, методы причины никновения, сущность, методы причины никновения, сущность, методы причины на причина на причин	Про- акти- иных риск. сущ- воз- годы риск. сущ-			
---	---	--	--	--

заочная форма обучения

		час
Основы теории управление риском как отрасль знания. Логические и исторические предпосылки создания теории управления риском. Роль и место риска, как экономической категории. Сущность риска, основные элементы, причины возникновения. Объекты и субъекты риска. Общая классификация опасностей. Классификация рисков. Критерии классификация по факторам возникновения, по характеру учета, по характеру учета, по характеру учета, по характеру учета, по характеру обревозникновения). Краткая характеристика основных видов риска в различных сферах экономической деятельности Методы управления риском. Основные принципы управления риском (избежание, снижение, принятие, отказ). Этапы процесса управления риском (выявление и оценка, сравнение методов воздействия на риск, выбор методов	21	23

		воздействия. на риск)				
2	Основы риск-менеджмента.	Окружающая рисковая среда организации. Рисковая микросреда организации. Ценности компании, подверженные риску. Типовые риски, которым подвержена организация. Склонность к риску. Что лежит в основе рискового поведения человека. Психологические факторы, определяющие поведение человека в условиях риска. Опыты Канемана и Тверски. Отношение к риску: позиция компании. Компании лемминг, дронт, страус и сова. Рациональный уровень риска и этап развития организации. Модель управления риском. Основные элементы риск менеджмента. Краеугольные камни риск-менеджмента. Правила управления рисками. Определение рамок рискменеджмента. Определение склонности к риску. Создание культуры риск-менеджмента. Методический арсенал диагностики риска. Выгоды риск-менеджмента	1	2	21	24
3	Методы определения и оценки риска.	Методы диагностики рисков. Источники сбора информации для идентификации рисков. Методический арсенал диагностики рисков. Картографирование рисков фирмы. Учет рисков в экономических решениях фирмы. Особенности идентификации и картографирования рисков для российских компаний. Методы прогнозирования рисков: метод использования аналогов, статистический метод, метод логических построений, математические методы, экспертный метод, натурное моделирование. Построение карты рисков. Различные варианты построения рискографии предприятия. Методы выявления риска. Опросные листы, карты потоков, прямая инспекция, анализ финансовой и	1	2	21	25

	T	1		1	T	
		управленческой отчетности.				
		Сущность и роль в оценке				
		риска. Оценка вероятности не-				
		благоприятных событий				
		через сценарный подход. Метод				
		построения деревьев событий.				
		Метод «события-последствия».				
		Метод деревьев отказов. Метод				
		индексов опасности. Статисти-				
		ческие и вероятностные подходы				
		к количественной оценке риска.				
		Дисперсия и вариация как меры				
		риска. Использование распреде-				
		лений Пуассона, Бернулли,				
		Гаусса, Больцмана для оценки				
		риска.				
4	Организация управления	Функции управления рисками				
	рисками	руководителей высшего звена.				
		Функции управления рисками в				
		деятельности отдельных подраз-				
		делений организации. Функции				
		специализированного органа				
		управления рисками. Меры				
		риск-менеджмента. Структура				
		программы управления рисками.				
		Макет программы управления				
		рисками и ее финансирование.				
		Построение программы				
		Управления рисками. Разработка				
		мер реагирования: избежание,				
		снижение, принятие рисков.				
		Способы управления рисками:	1	2	22	24
		организационный, финансовый,				
		договорной подходы.				
		Финансовый аспект управления				
		рисками: коэффициентный ана-				
		лиз				
		рисковой позиции фирмы.				
		Выработка и принятие решений				
		по стратегии управления риска-				
		ми.				
		Разработка механизмов миними-				
		зации устранения рисков.				
		Механизм финансирования рис-				
		ков. Дособытийное и послесо-				
		бытийное финансирование. За-				
		траты на риск.				
5	Практика построения	Опыт построение интегральной				
	систем управления	систему управления рисками				
	систем управления	• • • •				
		металлургической компании. Эволюция системы управления	1		21	22
		рисками. Задачи, решаемые на	1		۷1	22
		^				
		первом				
		этапе (фрагментарный подход).				

		Задачи, решаемые на втором			
		этапе (интегральный подход).			
		Политика в области управления			
		рисками. Факторы рисков. Карта			
		рисков.			
		Матрица принятия решений. Ре-			
		гламенты управления рисками.			
		Трехуровневая яистема управ-			
		ления рисками предприятия.			
		Цели и функции каждого уровня.			
		Эффект от внедрения системы			
		управления рисками.			
		Опыт построения системы			
		управления операционными			
		рисками. Ситуации, показываю-			
		щая уровень			
		подверженности компании опе-			
		рационными рисками.			
		Требования к системе построения			
		операционных рисков: рисковая			
		модель компании; субъекты			
		управления рисками; регламен-			
		тирующие документы. Реализа-			
		ция системы: описание			
		бинес-процессов и выявление			
		рисков; оценка рисков и отбор			
		значимых рисков; разработка			
		мероприятий по управлению			
		рисками; внедрение системы			
		управления рисками. Как система			
		реагирует на операционные			
		риски.			
6	Типовые решения управ-	Производственный риск. При-			
	ления риском в различных	чины возникновения, структура,			
	областях	сущность, методы управления.			
		Организация управления произ-			
		водственным риском. Риски			
		неисполнения хозяйственных			
		договоров. Риски усиления кон-			
		куренции. Риски возникновения			
		непредвиденных расходов и со-			
		кращение доходов. Риски потери			
		имущества предприниматель-			
		ской организации. Риск невос-		22	22
		требованности продукции.			
		Промышленная безопасность.			
		Управление рисками в промыш-			
		ленности.			
		Финансовый риск. Причины			
		возникновения, сущность, ме-			
		тоды управления. Риски лик-			
		видности в финансовых инсти-			
		тутах. Механизмы управления			
		ликвидностью.			
		Инвестиционные риски, Бирже-			

вые риски. Процентные риски.				
Рыночные рис-				
ки.Инвестиционный риск. Зако-				
номерности управления				
инвестиционными проектами.				
Структура инвестиционных				
рисков. Особенность влияния				
странового риска на деятельность				
проекта. Технологии учета риска				
проекта.Проблемы количе-				
ственной оценки риска проекта.				
Отражение риска проекта в дис-				
контных ставках. Методы по-				
строения ставки дисконта. Про-				
блемы страхования				
инвестиционных рисков. Прак-				
тика страхования инвестицион-				
ных рисков. Коммерческий риск.				
Причины возникновения, сущ-				
ность, методы управления.				
Страновой риск. Причины воз-				
никновения, сущность, методы				
управления. Валютный риск.				
Причины возникновения, сущ-				
ность, методы управления в				
сфере производства и сбыта.				
Банковские риски. Причины				
возникновения, структу-				
ра, сущность, методы управления.				
Организационный риск. Причи-				
ны возникновения, сущность,				
методы управления.				
Итого	4	8	128	140

5.2 Перечень лабораторных работ

Не предусмотрено учебным планом

6. ПРИМЕРНАЯ ТЕМАТИКА КУРСОВЫХ ПРОЕКТОВ (РАБОТ) И КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ

В соответствии с учебным планом освоение дисциплины предусматривает выполнение курсовых работ в 3 семестре обучения.

Примерная тематика курсовой работы: «Анализ и управление финансовыми рисками на предприятии»

Задачи, решаемые при выполнении курсовой работы:

- в углублении полученных знаний в процессе освоения данной дисциплины
 - в приобретении практических навыков по анализу финансовых рисков
- в приобретении практических навыков по управлению финансовыми рисками

Курсовая работа включат в себя графическую часть и расчетно-пояснительную записку.

7. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

7.1. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания 7.1.1 Этап текущего контроля

Результаты текущего контроля знаний и межсессионной аттестации оцениваются по следующей системе:

«аттестован»;

«не аттестован».

Компе- тенция	Результаты обучения, характеризующие сформированность компетенции	Критерии оценивания	Аттестован	Не аттестован
ДПК-5	Знать современные концепции бухгалтерского учета и отчетности; совокупность приемов и способов бухгалтерского учета, анализа, аудита;	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь выстроить иерархическую модель управления финансовой службой с эффективным распределением обязанностей на основе фундаментальных знаний и осознания концепций	Студент демонстрирует умение решать практические задачи на основе полученных теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	бухгалтерского учета Владеть практическими навыками распределения функций по учету внеоборотных активов, производственных запасов, затрат на производство готовой продукции и товаров, денежных средств для формирования системы ключевых показателей оценки деятельности организации; способами оценки финансовых результатов с целью предотвращения отрицательных результатов ее деятельности.	Студент владеет навыками применения полученных теоретических и практических знаний при решении задач прикладного характера.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
OK-3	Знать принципы планирования личного времени, способы и методы саморазвития и самообразования	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь самостоятельно овладевать знаниями и навыками их применения в профессиональной деятельности; оценивать систему финансовых рисков в деятельности фирмы; давать правильную самооценку, намечать пути и выбирать средства развития достоинств и устранения недостатков.	Студент демонстрирует умение решать практические задачи на основе полученных теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть навыками самостоятельной, творческой работы, умением организовать свой труд; способностью к самоанализу и самоконтролю, к самообразованию и самосовершенствованию, к поиску и реализации новых, эффективных форм	Студент владеет навыками применения полученных теоретических и практических знаний при решении задач прикладного характера.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах

		1		
	организации своей деятельности;			
	навыками использования творче-			
	ского потенциала для управления			
TTIC 7	системой рисков на предприятии.	0	D	TT
ПК-5	Знать основные источники инфор-	Студент демонстри-	Выполнение	Невыполнение
	мации, дающие возможность изу-	рует необходимый	работ в срок,	работ в срок,
	чать результаты, полученные оте-	объем теоретических	предусмотрен-	предусмотрен-
	чественными и зарубежными ис-	знаний.	ный в рабочих	ный в рабочих
	следователями в избранной области		программах	программах
	исследований.		ъ	**
	Уметь применять базовые микро-	Студент демонстри-	Выполнение	Невыполнение
	экономические модели, если это	рует умение решать	работ в срок,	работ в срок,
	необходимо в избранной области	практические задачи	предусмотрен-	предусмотрен-
	исследований.	на основе полученных	ный в рабочих	ный в рабочих
	7	теоретических знаний.	программах	программах
	Владеть навыками анализа источ-	Студент владеет	Выполнение	Невыполнение
	ников информации, дающих воз-	навыками применения	работ в срок,	работ в срок,
	можность изучать результаты, по-	полученных теорети-	предусмотрен-	предусмотрен-
	лученные отечественными и зару-	ческих и практических	ный в рабочих	ный в рабочих
	бежными исследователями в	знаний при решении	программах	программах
	избранной области исследований.	задач прикладного		
шс	2	характера.	D	11
ПК-6	Знать виды инвестиционных про-	Студент демонстри-	Выполнение	Невыполнение
	ектов и их особенности;	рует необходимый	работ в срок,	работ в срок,
	различные критерии оценки эф-	объем теоретических	предусмотрен-	предусмотрен-
	фективности инвестиционных про-	знаний.	ный в рабочих	ный в рабочих
	ектов; особенности учета времен-		программах	программах
	ной ценности денежных ресурсов в			
	инвестиционных решениях;	C	D	TT
	Уметь обосновывать экономиче-	Студент демонстри-	Выполнение	Невыполнение
	скую эффективность инвестици-	рует умение решать	работ в срок,	работ в срок,
	онных проектов на основе отдель-	практические задачи	предусмотрен-	предусмотрен-
	ных методов оценки; составить ин-	на основе полученных	ный в рабочих	ный в рабочих
	вестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска;	теоретических знаний.	программах	программах
		Ститом в полож	Выполнение	Портинализация
	Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях	Студент владеет навыками применения	работ в срок,	Невыполнение работ в срок,
	•	полученных теорети-	предусмотрен-	
	неопределенности и риска; методикой расчета	ческих и практических	предусмотрен- ный в рабочих	ный в рабочих
	экономических и социаль-	знаний при решении	программах	программах
	но-экономических показателей	задач прикладного	программах	программах
	оценки эффективности инвестици-	характера.		
	онных решений.	ларактера.		
ПК-8	Знать - методы многофакторного	Студент демонстри-	Выполнение	Невыполнение
1111-0	стратегического анализа биз-	рует необходимый	работ в срок,	работ в срок,
	нес-среды; основные источники	объем теоретических	предусмотрен-	предусмотрен-
	информации по проблемам страте-	знаний.	предусмотрен- ный в рабочих	ный в рабочих
	гического управления развитием	Situliani.	программах	программах
	бизнеса.		L L	L L
	Уметь систематизировать наблю-	Студент демонстри-	Выполнение	Невыполнение
	даемые явления и процессы на ос-	рует умение решать	работ в срок,	работ в срок,
	нове методов анализа финансовых	практические задачи	предусмотрен-	предусмотрен-
	рисков; находить теоретическое	на основе полученных	ный в рабочих	ный в рабочих
	основание для объяснения наблю-	теоретических знаний.	программах	программах
	даемых явлений и процессов и вы-	1	1 1	1 1
	бирать методологию их исследова-			
	ния.			
	Владеть методологическими прие-	Студент владеет	Выполнение	Невыполнение
	мами принятия стратегических ре-	навыками применения	работ в срок,	работ в срок,
	шений на микро- и макроуровне и	полученных теорети-	предусмотрен-	предусмотрен-
	оценки альтернатив развития биз-	ческих и практических	ный в рабочих	ный в рабочих
	неса в условиях рынка	знаний при решении	программах	программах
	, r	-L L	1 - F	1 -1

		задач прикладного характера.		
ПК-9	Знать внешние и внутренние источники информационных данных, используемых для анализа и оценки рисков; методы, способы и средства получения информации для разработки и реализации стратегии оценки финансовых рисков.	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь выбрать инструментальные средства для обработки экономических информационных данных.	Студент демонстри- рует умение решать практические задачи на основе полученных теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть методикой анализа данных для проведения необходимых экономических расчетов; методами анализа информации для проведения расчетов по оценке финансовых рисков; навыками работы с информацией по выявлению и анализу рисков.	Студент владеет навыками применения полученных теоретических и практических знаний при решении задач прикладного характера.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
ПК-10	Знать методы составления прогноза основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом; основные источники информации, используемые в прогнозировании.	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь систематизировать наблюдаемые явления и процессы с целью разработки прогнозов; осуществлять эффективный поиск информации о состоянии организации и результатах ее деятельности; использовать методы прогнозирования в процессе разработки стратегий развития бизнеса;	Студент демонстрирует умение решать практические задачи на основе полученных теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть методологическими правилами и приемами сценарного прогнозирования; методами оценки альтернативных прогнозов основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом.	Студент владеет навыками применения полученных теоретических и практических знаний при решении задач прикладного характера.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
ДПК-2	Знать нормативно-правовую базу, регламентирующую деятельность предприятия в различных организационно- правовых формах и сферах деятельности.	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь осуществить выбор наиболее эффективной организационно-правовой формы для минимизации уровня неопределенности.	Студент демонстрирует умение решать практические задачи на основе полученных теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть способностью применения баз данных и информационных систем при реализации организаци-	Студент владеет навыками применения полученных теорети-	Выполнение работ в срок, предусмотрен-	Невыполнение работ в срок, предусмотрен-

	онно-управленческих функций в	ческих и практических	ный в рабочих	ный в рабочих
	целях анализа финансовых рисков	знаний при решении	программах	программах
		задач прикладного характера.	1 1	1 1
OK-1	Знать методы анализа и синтеза информации	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследования информацию.	Студент демонстрирует умение решать практические задачи на основе полученных теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть способностью к абстрактному мышлению, анализу и синтезу.	Студент владеет навыками применения полученных теоретических и практических знаний при решении задач прикладного характера.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
OK-2	Знать основные приемы действий в нестандартных бизнес-ситуациях; содержание социальной и этической ответственности при принятии бизнес-решений.	Студент демонстрирует необходимый	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь действовать в нестандартных ситуациях; нести социальную и этическую ответственность за принятые управленческие решения.	Студент демонстри- рует умение решать практические задачи на основе полученных теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть методиками и технологиями действий в нестандартных бизнес-ситуациях.	Студент владеет навыками применения полученных теоретических и практических знаний при решении задач прикладного характера.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
ОПК-3	Знать виды управленческих решений и методы их принятия; принципы построения организационных структур и распределения функций управления.	Студент демонстрирует необходимый объем теоретических знаний.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Уметь организовывать командное взаимодействие для решения задач в части анализа и управления рисками; воздействовать на персонал различными методами для достижения целей организации; разрабатывать и принимать оптимальные решения; организовывать их реализацию и контроль за исполнением решений; управлять работой производственного коллектива и работать в команде.		Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах
	Владеть методами реализации основных управленческих функций (принятие решений, организация, мотивирование и контроль) в вопросах снижения степени неопределенности	Студент владеет навыками применения полученных теоретических и практических знаний при решении задач прикладного характера.	Выполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах	Невыполнение работ в срок, предусмотренный в рабочих программах

7.1.2 Этап промежуточного контроля знаний

Результаты промежуточного контроля знаний оцениваются в 1, 2 семестре для очной формы обучения по четырехбалльной системе:

«отлично»;

«хорошо»;

«удовлетворительно»;

«неудовлетворительно».

Компе-	Результаты обучения, характери-	Критерии		•	X 7	***
тенция	зующие сформированность компетенции	оценивани я	Отлично	Хорошо	Удовл.	Неудовл.
ДПК-5	Знать современные концепции бухгалтерского учета и отчетности; совокупность приемов и способов бухгалтерского учета, анализа,	Тест	Выполнени е теста на 90- 100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правиль- ных отве- тов
	аудита; Уметь выстроить иерархическую модель управления финансовой службой с эффективным распределением обязанностей на основе фундаментальных знаний и осознания концепций бухгалтерского учета	Решение стандартны х практически х задач	Задачи ре- шены в полном объеме и получены верные ответы	Продемон- стр ирован верный ход решения всех, но не получен верный от- вет во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
	Владеть практическими навыками распределения функций по учету внеоборотных активов, производственных запасов, затрат на производство готовой продукции и товаров, денежных средств для формирования системы ключевых показателей оценки деятельности организации; способами оценки финансовых результатов с целью предотвращения отрицательных результатов ее деятельности.	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
OK-3	Знать принципы планирования личного времени, способы и методы саморазвития и самообразования	Тест	Выполнени е теста на 90- 100%	Выполнение теста на 80- 90%	Выполнение теста на 70- 80%	В тесте менее 70% правильных ответов
	Уметь самостоятельно овладевать знаниями и навыками их применения в профессиональной деятельности; оценивать систему финансовых рисков в деятельности фирмы; давать правильную самооценку, намечать пути и выбирать средства развития достоинств и устранения недостатков.	Решение стандартны х практически х задач	Задачи ре- шены в полном объеме и получены верные ответы	Продемон- стр ирован верный ход решения всех, но не получен верный от- вет во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
	Владеть навыками самостоятельной, творческой работы, умением организовать свой труд; способностью к само-	Решение прикладных задач в конкретной	Задачи ре- шены в полном объеме и	Продемон- стр ирован верный ход решения	Продемонстр ирован вер- ный ход решения в	Задачи не решены

предметной получены времый ответы месты получены и предметной общеги неборазованию, к поиску и реализации новых, эффективных форм организации посой дастольности; двамым и виспользования творческого потещивала двя угравления системой рисков на предприятии. ПК-5 Знать оспольза источника и заробживами и которыми и заробживами и зарожживами и зарожживами и зарожживами и зарожживами и зарожживами и зарожживами и зарожжи				T	ı	1-	1
редигнатильновых, эфрективных фрор организации смоей деятельности: навыкам и исполькования творческого потенциала для управление информации. Дающие возможности нужать результать, полученые отечественными и зарубсжимы исследований. Тик-5 Знать применять базовые микроэкоможические модели, стандарты полном объеме и избранной области исследований. Туметь применять базовые микроэкоможические модели, стандарты полном объеме и избранной области исследований. В дала и полном объеме и избранной области исследований. В дала и полном объеме и избранной области исследований. Тик-6 Знать виды инвестиционных прежеными издрабежными издрабежным		анализу и самоконтролю, к	предметной	получены	всех, но не	большинстве	
реализации полых, эффек- тивных форм организации своей деятельности; нявыкая- ми использования пворте- ского потенными даму управ- ления системой рисков на информации, дающие воз- можность изучать результа- тац, полученные от- плоятелями в изрубежными иссле- дователями в изфранной области исследова- ний. Владеть навыками анализа источников информации, дающих возможность изучать результати, полученные от- истепенными и зарубежными и источников информации, дающих возможность изучать результати, полученные от- истепенными и зарубежными и источников информации, дающих возможность изучать результати, полученные от- истепенными и зарубежными и источников информации, дающих возможность изучать результати, полученные от- истепенными и зарубежными и источников информации, дающих возможность изучать результати, полученные от- истепенными и зарубежными и источников информации, дающих возможность изучать результати, полученные от- истепенными и зарубежными и источников информации, дающих возможность изучать результати, полученные от- истепенными и зарубежными и источников информации, дающих возможность и участь информации, дающих возможность изучать результати, полученными объеме и источников информации, дающих возможность и источников информации, дающих возможность и источников информации, дающих возможность и источников информации, дающих возможности и источников информации, дающих возможность и участь объеме и источников информации, дающих возможности и источников информации, дающих возможности и источников информации, дающих возможность и источников информации, дающих возможности и источников			области	верные		задач	
Тимым форм организации своей деятельности навыкам и веловьзования творческого потенциалы для угравалений пиформации, дающие вольности инди информации, дающие вольности и нужить применять базовые мижим веловожной области и сестований. Тест		-		ответы	верный от-		
Выполнение выполнение выполнение выполнение выполнение вольского потенциала для управления системой рисков на предприятии. Зиять основные источники нефермации, дающие вольского доявтетими в избранной области исследований. Уметь применять базовые микрожопомические модели, сстагдартны области исследований. Решение придадиму в далачи репринае ответы набранной области исследовании. Дающих в сокможность кузучать результатий. Решение придадиму дающих в сокможность кузучать результатий, дающих в сокможность кузучать результатий, дающих в сокможность кузучать предметной подучены избранной области нестепенными и зарубежными переменными переменными в дарубежными и дающих в сокможность кузучать далач в полном нестепенными и зарубежными переменными п					вет во всех		
ПК-5 ПК-5 ПК-5 ПК-5 ПК-5 ПК-5 ПК-5 ПК-6					задачах		
Ванолнени выполнени решения предприятии. В тесте на предприятии. В тесте на предприятии. В тесте на предприятии прожности испекты, полученные от ставдартны исследований. Решение на полученые ответь на полученые ответь на полученые объеме и полученые объеме и полученые объеме и полученые объеме и полученые ответь в посте по всех задачи в полученые объеме и полученые объеме и полученые ответь по всех задачи в полученые объеме и полученые полученые объеме и полученые ответь по всех задачи в полученые объеме и полученые объеме и полученые объеме и полученые объеме и полученые ответь в поект задачи в полученые объеме и полученые полученые объеме и полученые полученые объеме и полученые объеме и полученые объеме и полученые объеме и полученые полученые объеме и полученыем объеме и полу		своей деятельности; навыка-					
ПК-5 Знать основные источники информации, дающие возможносты иучать результать, полученые отечеными и зарубежными исследований. Решение дакам и на вубранной облаети исследований и дакам и на вубранной облаети и стандартны дакам и на вубранной облаети и стандартны и степным и на результать, полученые отечественными и а вубраемной предметной облаети и стандартны и и править и предметной облаети и стандартны и и править и предметной облаети и стандартны и и править и предметной облаети и стандартны и получены и решения и решений облаети и решений облаети и решения и решений и р		ми использования творче-					
ПК-5 Знать основные источники информации, дающие возможность изучать результать, получение песточности и деятельными и зарубежными исследовати исследовати исследовати и селедовати и		ского потенциала для управ-					
Виагь основные источники информации, дающие возможность изучать результать, полученные ответы испексанований. Решение ответы в дами в изрубежеными и сагрований. Решение ответы в результать, получены объеме и продемонет чественными и зарубежеными в израми в результаты, получены объеме и предметной песледователями в израми и проектов и их особенности депежных рестовных проектов и их особенности депежных рестовных методов оценки, составить инвестиционных проектов и их особенности депежных рестовных методов оценки, составить инвестиционных проектов и их особенности депежных рестовных методов оценки, составить инвестиционных проектов и их особенности депежных рестовных методов оценки, составить инвестиционных проектов и их особенности депежных рестовных методов оценки, составить инвестиционных проектов и их особенности депежных рестовных методов оценки, составить инвестиционный потрежей в сустом и их особенности депежных рестовных методов оценки, составить инвестиционный потрежей в сустом и их особенности дележных рестовных методов оценки, составить инвестити депежных рестовных методов оценки, составить инвестиционных проектов и их собенности учета временной дености депежных рестовных методов оценки, составить инвести и дележных рестовных методов оценки, составить инвестытать полном практически ответы в объеме и получены всех, по не получены всех, но		ления системой рисков на					
Виформации, дающие во-можность изучать результать, полученые отечественными и зарубежными исследований. Решение получены поличеные отечеными и зарубежными исследований. Решение получены поличеными получеными получ		предприятии.					
90-100% 90% 80% 80% правилент полими зарубежными исследоватий. 90-100% 90% 80% практически получены верный тол полимом получены получены получены прожктов и исследоватий. 90-100% 90% 80% практические модели, ссли дартны десли это необходимо в избранной области исследований. 90-100% 90% 90% 80% практические модели, ссли дартны десли это необходимо в избранной области исследоватий. 90-100% 90%	ПК-5	Знать основные источники	Тест	Выполнени	Выполнение	Выполнение	В тесте
Можность изучать результать да объеме и межность изучать результать, полученым практические модели, если это необходимо в избранной области исследований. Решение микроэкономические модели, если это необходимо в избранной области исследований. Решение межному объеме и получены дающих возможность изучать инвестиционных решениях и инвестиционных ресегии инвестиционных ресурсов в инвестиционных проектов и из составить инвести денежных инвестиционных ресурсов в инвестиционных проектов и практически и риска; котодов опенки, составить инвести и дражда в условиях неопределенности и риска; межды инвестиционных проектов и практически и риска; межды объеме и получены в стем в получены и получены нестиционных проектов и практически объеме и получены в стем в получены в стем в получены и получены и получены и основе отдельных методов опенки; составить инвести и риска; межды объеме и получены в сетов на основе отдельных методов опенки; составить инвести и риска; межды объеме и получены в сетов на основе отдельных методов опенки; составить инвести и риска; межды объеме и получены в сетов на основе отдельных методов опенки; составить инвести и риска; межды объеме и получены в сетов на основе отдельных методов опенки; составить инвести и риска; межды объеме и получены в сетов на основе отдельных методов опенки; составить инвестиционных проектов и получены в сетов на основе отдельных методов опенки; составить инвести и риска; межды объеме и получены в сетов на основе отдельных методов опенки, составить инвестиционных пректов объеме и получены в сетов на основе отдельных методов опенка в сетов на основе отдельных методов объеме и получены в сетов на основнением объеме и получены в сетов на объеме и получены в сетов на объеме и получены в сетов на основнением объеме и получены в сетов на объ		информации, дающие воз-		е теста на	теста на 80-	теста на 70-	менее 70%
Там, полученные отечественными и зарубежими исследоватиями в избранной области исследований. Решение коточеные отечет примания и зарубежными и зарубежными и сподучены в избранной области и и получены в получены получены в получены в получены в получены в получены в получены получены в получены получены в получены в получены в получены в получены в получены получены в получены получены в получены по		= =		90- 100%	90%	80%	правиль-
Владеть навыками анализа истенсарований. Решение микрожономические модели, если это необходимо в избранной области исследовании. Решение полученые ответы в полиом исстедовательными и зарубежными пестедоватия (пестадоватия) подраченые ответы избранной области изарубежными пестедовательными и зарубежными пестедовательными пестедовательными пестедовательными проектов и кособенности учета временной ценности денежных ресурсов в инпестиционных проектов, сообенности учета временной ценности денежных ресурсов в инпестиционных проектов на сонове отдельных методов объеме и риска; Владеть навыками проведения инвестиционных проектов на сонове отдельных методов объеме и риска; методикой расчета уста объеме и риска; методикой расчета уста уста объеме и риска; ответы в редые ответы и получены верный ответ во всех задачах в получены верный ход объеме и получены верный ход объеме и получены верные ответы в редые ответы в редые ответы в редые ответы в получены объеме и получены верный ход объеме и получены верный ход объеме и получены верный ход объеме и получены верные ответы в редые ответы в редые ответы в редые ответы в получены верный ход объеме и п							_
Дователями в избранной об- дасти исследований. Уметь применять базовые микроэкономические модели, если это необходимо в из- различных возможность изучать результаты, полученны исследоватий. Владеть навыками анализа исследований. Решение издраний области исследователями в избранной области исследователями в избранной области исследователями в избранной области исследоватий. Решение прикладных дающих возможность изучать результаты, полученны области исследователями в избранной области исследований. Тест неста на проектов и их особенности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экопомическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценких, составных методов оценких, составных инвестиционного в на в условиях неопределенности и риска; Решение получены в сех, но не получены области инвестиционных проектов на основе отдельных проектов на основе отдельных методов оценки; составных методов оценки; составных инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составных методов оценки; составных инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических показатедей опенки эффективности инвестиционного анализа в условиях неопределенности увка; методикой расчета экономических показатедей опенки эффективности инвестиционных решений прижданных прикладных в условиях неопределенности и предметной получены верный ход решения в полном объеме и получены в получены верный ход решения в полном объеме и получены в получены в полном объеме и получены в полном объеме и получены в получены в полном объеме и получены в полном об							тов
Владеть навыками анализа источников информации, дающих возможность изучеты исследований. Решение детвенными и зарубежными прежетов инжестиционных проектов и их особенности; различные критерии опенки эффективность инвестиционных проектов, особенность учета временной пенежных ресурсов в инвестиционных проектов, особенность инвестиционных проектов, особенность инвестиционных поственных методов оценки; составить инвестиционных проектов пенерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения и риска; Владеть навыками проведения и в сестанизация в сеста новать в верные объеме и получены в верный ответы в верный ответы в тоя и получены в получены получены получены получены получены в получены получены в получены получены в получены получены в получены в получены в получены в получены получены в получ							
Уметь применять базовые микроэкономические модели, если это необходимо в из- бранной области исследований. Хадач полном объеме и получены источников информации, дающих возможность изучать результаты, полученые ответы избранной области изфранной области исследователями в избранной области исследоватий. Тест Выполнени исследователями в избранной области избранной области избранной области избранной области избранной исследователями изфранной области избранной области избранной области избранной исследователями исследователями исследователями в избранной области избранной области избранной области избранной исследователями исследователями исследователями в избранной области избранной исследователями в избранной области избранной избранной избранной избранной избранной избранной избранной избранном избранном избранном избранном избранном избранном избранном избранном избранн							
микрохономические модели, бранной области исследований. Владеть навыками анализа источников информации, дающих возможность изучать результаты, полученые исследоватий исследоватий и зарубежными исследоватий. ПК-6 Знать виды инвестиционных проектов и их особенности учета временной ценкогидионных проектов и их особенности учета временной пенности денежных ресурсов в инвестиционных проектов, особенность инвестиционных проектов и их особенность инвестиционных проектов и и прика; в условиях неопределенной получены и риска; Владеть навыками проведений получены и урска; Владеть навыками проведений получены и урска; Владеть навыками проведений получены и урска; в условиях неопределенной получены и урска; в условиях неопределенной получены объеме и получены в объеме и получены в оста и получены в объеме		1 1	Решение	Запаци пе-	Пролемон-	Пролемонстр	Запаци не
Владеть навыками анализа источников информации, дающих козможность изучать результаты, полученым избранной области исследований. Решение избранной области исследований. Решение избранной полученым области исследований. Решение избранной области исследований. Решение избранной полученым области информации, различные кривати полученым полученым полученым полученым полученым полученым области информации, различные крива полученым полу				_	-		
Владеть навыками инализа источников информации, дающих возможность изучать результаты, полученые избранной области исследований. Тест инвестиционных проектов и их особенности учета временной ценюсти денежных ресурсов в инвестиционных проектов и основе отдельных методов оценки; составить инвестиционных проектов и в риска; Решение стандартны и денежных ресурсов в инвестиционных проектов и в основе отдельных методов оценки; составить инвестиционных проектов и в риска; Решение задач в основе отдельных методов оценки; составить инвестиционных проектов и в риска; Решение задач в объеме и приска; Решение задач в объеме и продеменьой получен верный отдень и теста на 80-90-100% 90% 90% 80% 1 Продемонстр ирован верные опърчен верный отдена верные объеме и получен верный отдена верные объеме и получены верный отдена верные объеме и получены верный отдена верные ответы в весх, но не получены верный отдена верные объеме и получены верный отдена верные ответы в теста на 80-90-100% 90% 90% 80% 1 Продемонстр ирован верные ответы весх, но не прикадных задач верный отдена верные ответы весх, но не прикадных задач верные ответь весх, но не прикадных задач верные ответь весх задачах верный ход решения получен верный отдены весх, но не продементот прикадных и получены весх, но не продементот веть весх, но не продементот получены весх, но не продементот объеме и получены весх, но не получены весх, но не продементот веть весх но не получены весх, но не продементот веть весх но не получены весх но не получены весх, но не продементот веть весх не не получены весх но не получены весх, но не получены весх не н			-			•	Решены
Владеть навыками анализа источников информации, дающих возможность изучать результать, полученные отечественными и зарубежными избранной области исследователями в избранной области верные ответы в верные ответь в ответь инвестиционных проектов и имеестиционных проектов и имеестиционных проектов и имеестиционных проектов и имеет области учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных проектов и имеет получены основе отдельных методов оценки; составить инвестиционного апализа в условиях неопределенной задач в опкретной и риска; Владеть навыками проведения и риска; методикой расчета экономических посазателей оценки эфективности инвестиционных решений прижага методикой расчета экономических показателей оценки эфективности инвестиционных решений области и риска; методикой расчета экономических показателей оценки эфективности инвестиционных решений области инверный острастным объеме и прижага в прижаганых решений области ответы верный ответь в объеме и прижага методикой расчета экономических показателей оценки эфективности инвестиционных решений области верный ответь в оказа в области ответь в оказа в области верный ответь в оказа в области верный ответь в оказа в области верный год объеме и продеменой объеме и получены объеме и продеменой объеме и продемено объеме и продемено объеме и продеменой объеме и продемено объеме и получены объеме и продемено объеме и продемено объеме и продемено объеме и продеме					_	-	
Владеть навыками анализа источников информации, дающих возможность изучать результаты, полученыме отечественными и зарубежными исследователями в подметной области исследований. ПК-6 Знать виды инвестиционных проектов и их особенности учета временной инестиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективности инвестиционных проектов в инвестиционных проектов инвестиционных проектов инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционных проектов и в условиях неогределенности и риска; Владеть навыками проведения и из учета временной получены области и риска; Владеть навыками проведения инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения и прожденной области и риска; методикой расчета экономических и социальной области и риска; методикой расчета экономических и социальной области и риска; методикой расчета экономических и социальной области и оценки эффективности и риска; методикой расчета экономических и социальной области и риска; методикой расчета экономических и социальной расчета области и риска; методикой расчета экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений.		=	-		-		
Владеть навыками анализа источников информации, дана и информации и информации, дана и информации, дана и информации		пии.	л задач				
Владеть навыками анализа источников информации, дающих возможность изучать результаты, полученные ответы избранной области исследователями в избранной области исследований. ПК-6 ПК-6 Знать виды инвестиционных проектов и их особенности учета временной инвестиционных проектов; особенности учета временной пенности дележных ресурсов в инвестиционных проектов на осново отдельных методов оценки; оставить инвестиционных протрель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения и ценки зубрективности и и риска; Владеть навыками проведения и делеменых респечных проектов и получены области и риска; Владеть навыками проведения и делеменах респечных и роска; мотоды доходности и риска; оставить инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; мотоды доходности и риска; оставить инвестой доходности и риска; оставить инвестой доходности и риска; оставить инвестиционного анализа в условиях неопределенности и и риска; мотоды делеменах респечный дольных проветов но области и риска; оставить инвестой доходности и риска; мотодимный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; оставить инвестой доходности и риска; оставать доходность доходность доходность доходность доходность доходность доходность доход				_		задач	
Владеть навыками анализа источников информации, дающих возможность изучать результаты, полученные отечественными и зарубежными исследований. ПК-6 Знать виды инвестиционных проектов и их особенности учета временной ценки эффективность инвестиционных ресурсов в инвестиционных проектов, особенности учета временной ценния у Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведенености и риска; жетодикой расчета экономических и социально-вономических пожазательной веть в социально-вономических пожазательноми объеме и получены верный ход решения в большинстве стиционных рабками и получены верный ход решения в большинстве и получены верный ход объеме и получены верный ход решения в большинство стандами не т				ОТВСТЫ	-		
Владеть навыками анализа источников информации, дающих возможность изучать результаты, полученые отечественными и зарубежными исследователями в избранной области исследований. Тест вазиличые критерии оценки эффективности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных протфель с учетом генерируемой доходности и риска; в условиях неопределенности и риска; методивм решения в объеме и получены верный ход решения в конкретной получены верные ответы в полном объеме и получен верный ход решения в конкретной получены верный ход решения в конкретной получены объеме и получен верный ход решения в конкретной получены объеме и получен верный ход решения в конкретной получены объеме и получены объеме и получен верный ход решения в конкретной получены объеме и получен верный ход решения в конкретной получены объеме и получен верный ход решения в конкретной получены объеме и получен верный ход решения в конкретной получены объеме и получен верный от верный ход решения в конкретной получены объеме и получены верный ход решения в конкретной получены верный ход решения в конкретной получены верный ход решения в конкретной получены верный от ветны верный ход решения в конкретной получены верный ход решения в конкретной получены верный ход ветные и получены верный ход ветные и получены верный ход в конкретной получены верный ход в конкретной получены верный ход в конкретной объеме и получены верный ход в конкретной объеме и получены верный ход в кон							
источников информации, дающих возможность изучать результаты, получены исследователями в избраниой области исследователями в избраниой области исследований. Тест валичные критерии оценки эффективности инвестиционных проектов и их особенностигу учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестищионный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; методикой расчета в условиях неопределенноги и риска; методикой расчета в условиях неопределенности и получены верный ход решения в конкмретной объеме и получены объеме и получены верный ход решения в конкмретной объеме и получены объеме и получены объеме и получены верный ход решения в конкмретной объеме и получены верный ход решения верный ход решения в конкмретной объеме и получены верный ход решения в конкмретной объеме и получены верный ход решены верный ход ветный ход решения верный ход ветный ход решения ветный ход решены верный ход ветный ход решены верный ход ветный ход решены ветный ход ветн		D	D	2		П	2
дающих возможность изучать результаты, полученые отечественными и зарубежными исследователями в избранной области исследований. ТК-6 Знать виды инвестиционных проектов и их особенности учета временной ценкости денежных ресурсов в инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экономических рественный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционных порожном доходности и риска; методикой расчета экономических и социально-докомомических и социально-докомомических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Владеть навыками проведения и риска; методикой расчета экономических и социально-докомомических и социально-дению и объеме и получены верные объеме и получены верные объеме и получены верные объеме и получены верный ответы в режех, но не прикладных прожномических и социально-дению предметной предметной предметной объеме и получены верный ответы в объеме и получены получены получены верный ответы верный ответы верные объеме и получены получены получены объеме и получены получены верный ответы веск, но не прикладных предметной предметной предметной предметной объеме и получены объеме и получены объеме и получены верный ответы веск, но не получены получены верный ответы верные ответы веск, но не получены получены верный ответь веск, но не получены получены верный ответь веск, но не получены получены верный ответь веск задачах вобъеме и получены верный ответь веск задачах вобъеме и получены верный ответь веск задачах вобъеме и получены верный ответь веск но не получены верный ответь веск но не получены верный ответь веск но не получены верный ответь веск задачах вобъеме и получены верный ответь веск но не получены верный ответь веск но не получены верный ответь веск на получены верный ответь верный ответь веск задачах вобъеме и получены верный ответь верный ответь верные ответь верные ответь верный ответь верные ответь веск задачах вобъеме и получены верный ответь верный о				-			
результаты, получеными и зарубежными исследователями в избранной области исследований. ПК-6 Знать виды инвестиционных проектов и их особенности; различные критерии оценки эффективности инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; осставить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения и ириска; методимоного важной получены в условиях неопределенности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционных поределенноги и риска; Владеть навыками проведения инвестиционных поределенноги и риска; Владеть навыками проведения и риска; методикой расчета экономических и социально-исмонного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-исмонного объем и получены верный ответы в сех, но не объеме и получены получены верный ответы в регован получены верный ответы в оску предемения инвестиционных решения получены получены верный ответы в оску предемения и риска; методикой расчета экономических и социальности инвестиционных решений.			*			•	решены
ПК-6					_	-	
исследователями в избранной области исследований. Тест ветв овсех задачах выполнени е теста на 80- 90- 100% 90% 90% 90% правильных ответы верный ответь ве					-		
ПК-6 Знать виды инвестиционных проектов и их особенности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных проектов, особенности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-вей опценки эффективности инвестиционных решений. Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности опценки эффективности инвестиционных решений. Верный ответы выполнение е теста на 80-90-100% 90% 80% правильных ответа неста на 80-90-100% 90% 80% правильных ответа неста на 80-90-100% 90% 80% правильных ответов неста на 70-100% правильных ответь полном объеме и полном объеме и получены верный ответы верный ответы всех, но не получен ирован верный ход продемонстр ирован верный ответы всех, но не получен объеме и получ						большинстве	
Исс. проектов и их особенности; различные критерии оценки эффективности инвестиционных проектов; особенности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-лей оценки эффективности инвестиционных решений. В тесте неога на 80-90-100% 90% 80% правильных ответы на выполнение е теста на 80-90-100% 90% 80% правильных ответа полном объеме и полном объеме и получены верные ответы веть в всех, но не получен ответы верные ответы в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Выполнение теста на 80-90-100% 90% 80% правильных отвеста на 70-90% 80% правильных отвеста на 80-90-100% 90% 80% правильных отвеста на 70-90% 80% правильных отвеста на 70-90% 100,00% правильных ответа полном объеме и получены о			области	верные		задач	
ПК-6 Знать виды инвестиционных проектов и их особенности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестищионный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических и социально-вономических и социально-вономических и социально-вономических и социально-вономических и социально-вономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Тест Выполнени с теста на 80-90% 80% 80% правильных ответов не теста на 70-80% 80% правильных ответов верный ход практически объеме и получены верный ход решения в большинстве задач в полном объеме и получен объеме и получен объеме и получен верный ответы верный ответы верный ход объеме и получен объеме и получены объеме и получены объеме и получены объеме и получены верный ответы верный ответы области объеме и получены верный ответы объеме и получены верный ответы объеме и получены верный ответы объеме и получены объеме и получены объеме и получены верный ответы объеме и получены объеме и получены объеме и получены верный ответы объеме и получены верный ответы объеме и получены объеме и полу				ответы	-		
ПК-6 Знать виды инвестиционных проектов и их особенности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. В тест на 80- 90- 100% Задачи рестранных теста на 80- 90% Продемонтов теста на 80- 90% Продемонтов теста на 70- 80% Продемонтов теста на 70- 80% Продемонтов теста на 70- 80% Продемонтов теста на 80- 90% Продемонтов тести на теста на 80- 90% Продемонтов тести на 90- 90% Продемонтов тести на 80- 90% Продемонтов тести на 90- 90% Продемонтов тести		исследований.					
проектов и их особенности; различные критерии оценки эффективности инвестиционных проектов; особенности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических и социально-экономических и социально-экономических и обрасти оценки эффективности инвестиционных решений. в теста на 80- 90- 100% Задачи решения в полном объеме и получены верный ход решения верный ход объеме и получен верный ответы верный ход объеме и получены верный ход решения в большинстве получены верный ответы верный ответы верный ответы верный ответы верный ход объеме и получены верный ход решения в большинстве получены верный ответы верный ответь верный ответы верный ответы верный ответы верный ответы верный ход решения в большинстве задач верный ответы верный ход объеме и получены верный ответы верный ход объеме и получены верный ответы ирован верным ответы верный ответы верный ответы и получены верный ответы ответы верный ответы ответы верный ответы ответы ответы ответы							
различные критерии оценки эффективности инвестиционных проектов; особенности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения и получены в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Решение стандартны х адач решения в конкретной предметной объеме и получены в верный ответы в толном объеме и получены в верный ход верный ход верный ход верный ход верный ответы верный ответы верный ход объеме и получен верный ход решения полном объеме и получены в получены в получены в верный ход объеме и получены в получены области объеме и получены области ответы верный ответной объеме и получены верный ответы ответы верный ответной объеме и получены верный ответны верный ответной объеме и получены верный ответны и получены верный ответны верный ответных объемения инвектиционного анализа верный ход объеме и получены объемены и получены объемены и получены и получены объемена и получены и п	ПК-6		Тест	Выполнени			
эффективности инвестиционных проектов в инвестиционных решениях у Уметь обосновывать экономическую эффективность и риска; Владеть навыками проведения и риска; Владеть навыками проведения и риска; Владеть навыками проведения и риска; в условиях неопределенности и риска; методионных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционных решения и риска; Владеть навыками проведенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений.		проектов и их особенности;				теста на 70-	менее 70%
онных проектов; особенности учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инрестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-но-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений.		1 1		90- 100%	90%	80%	правиль-
учета временной ценности денежных ресурсов в инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестищионный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических и социальной оценки эффективности инвестиционных решений. Решение прикладных задач в конкомических и социально-экономических и инвестиционных решений. Решение прикладных задач в конкомических и социально-экономических и и социально-экономических и инвестиционных решений. Решение прикладных задач в конком решения в конком и предметной объеме и получены верный ответы верный ответы верный ответы ответы верный ответы							ных отве-
Денежных ресурсов в инвестиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений.		_ ·					тов
Тиционных решениях; Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Владеть навыками проведенов объеме и прикладных задач в полном объеме и получены верный ответы вет во всех задачах полном объеме и		*					
Уметь обосновывать экономическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социальной оценки эффективности инвестиционных решений. Владеть нарыками проведенности и риска; методикой расчета оценки эффективности инвестиционных решений. Владеть нарыками проведенности и риска; методикой расчета оценки эффективности инвестиционных решений. Владеть нарыками проведенности и риска; методикой расчета оценки эффективности инвестиционных решений. Вадачи реплодном объеме и получен верный ответы верный ход решения полном объеме и получены верный ответы верный объемений объемени объемени объе		денежных ресурсов в инве-					
мическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Вическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки эффективности инвестиционных решений. Тандартны инены в полном объеме и получены верный ответы верный ответы верный ход предементой объеме и получены верный ход решения получены верный ход решения в большинстве инены в полном объеме и получены верный ответы верные ответы верный ответ вет во всех задачах		стиционных решениях;					
мическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Вическую эффективность инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки эффективности инвестиционных решений. Тандартны инены в полном объеме и получены верный ответы верный ответы верный ход предементой объеме и получены верный ход решения получены верный ход решения в большинстве инены в полном объеме и получены верный ответы верные ответы верный ответ вет во всех задачах		Уметь обосновывать эконо-	Решение	Задачи ре-	Продемон-	Продемонстр	Задачи не
инвестиционных проектов на основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Вини продемон и практически объеме и получены верный ответы верный ответы верный ход решения верный ответы верный ход продемонстр ирован верный ход решения верный ответы верный ход инфармации инвески и ком		мическую эффективность	стандартны	_	_	ирован вер-	
основе отдельных методов оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-вономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Объеме и получены верный ответы верный ответы ирован верный ход решения верный ход решения получены получены получены верный ответы ирован верный ход решения верный ответы верные получен верный ответы отве			_	полном		•	
оценки; составить инвестиционный портфель с учетом генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Х задач Восех, но не получен верный ответ во всех задачах Задачи реприкладных задачах Продемонстр стр ирован верный ход решения верный ход решения получены верный ход решения верный ответы верные получен верный ответы верный ответы верный ответы верный ответы верный ответы верный ответы верный ответ вет во всех задачах						-	
получен верный ответы верный ответы верный ответы верный ответ верный ответы верный ответ вет во всех задачах Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Верные получен верный ответы верный ход ирован верный ход решения получены всех, но не объеме и получен верный ответы верный ответы верный ответы верный ответы вет во всех задачах			_		-		
генерируемой доходности и риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Вадачи реприкладных задач в конкретной предметной объеме и получены верный ход решения получены всех, но не области верные получен верный ответы объемены ответы верный ответы верный ответы верный ответы объемены ответы объем				-			
риска; Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально-экономических показателей оценки эффективности инвестиционных решений. Вадачи реприкладных задач в полном верный ход решения получены всех, но не объеме и получены верные получен верный ответы вет во всех задачах				_		, , -	
Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социальной пей оценки эффективности инвестиционных решений. Владеть навыками проведение прикладных адач в полном верный ход и решения в конкретной предметной получены всех, но не области верный ответы вет во всех задачах в конкретной оценки эффективности инвестиционных решений.							
Владеть навыками проведения инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социальной предметной предметной оценки эффективности инвестиционных решений. Владеть навыками проведение прикладных вадачи реприкладных видены в полном верный ход решения в большинстве получены верные получен верный ответы вет во всех задачах		ľ					
ния инвестиционного анализа в условиях неопределенности и риска; методикой расчета экономических и социально- но-экономических показатеной оценки эффективности инвестиционных решений. прикладных шены в стр ирован верный ход решения полном верный ход решения получены получены верные получен верный ответы вет во всех задачах		Владеть навыками проведе-	Решение	Залачи ре-		Продемонстр	Залачи не
в условиях неопределенности и риска; методикой расчета но-экономических показатеной объеме и решения но-экономических показатеной объеме и решения в решения в решения в решения в решения всех, но не получен получен получен получен верный ответы верный ответы вет во всех стиционных решений.		_		-	-		
и риска; методикой расчета конкретной объеме и решения шения в большинстве но-экономических показате-лей оценки эффективности инвестиционных решений.			_				решены
экономических и социаль- но-экономических показате- лей ответы верный от- оценки эффективности инве- стиционных решений.					_		
но-экономических показате- области верные получен задач ответы верный отоценки эффективности инвестиционных решений.		_			-		
лей ответы верный от- оценки эффективности инве- стиционных решений. ответы вет во всех задачах				-			
оценки эффективности инве- стиционных решений. вет во всех задачах			ооласти	_		задач	
стиционных решений. задачах				ответы	_		
11К-8 Знать - методы многофак- 1ест Выполнени Выполнение Выполнение В тесте	ПСО	-	т -	D		D	D
	11K-8	знать - методы многофак-	1 ест	выполнени	выполнение	выполнение	в тесте

	торного стратегического анализа бизнес-среды; основные источники информации по проблемам стратегического управления развитием бизнеса.		е теста на 90- 100%	теста на 80- 90%	теста на 70-	менее 70% правильных ответов
	Уметь систематизировать наблюдаемые явления и процессы на основе методов анализа финансовых рисков; находить теоретическое основание для объяснения наблюдаемых явлений и процессов и выбирать методологию их исследования.	Решение стандартны х практически х задач	Задачи ре- шены в полном объеме и получены верные ответы	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
	Владеть методологическими приемами принятия страте-гических решений на микрои макроуровне и оценки альтернатив развития бизнеса в условиях рынка	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Задачи ре- шены в полном объеме и получены верные ответы	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
ПК-9	Знать внешние и внутренние источники информационных данных, используемых для анализа и оценки рисков; методы, способы и средства получения информации для разработки и реализации стратегии оценки финансовых рисков.	Тест	Выполнени е теста на 90- 100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правиль- ных отве- тов
	Уметь выбрать инструментальные средства для обработки экономических информационных данных.	Решение стандартны х практически х задач	Задачи ре- шены в полном объеме и получены верные ответы	Продемон- стр ирован верный ход решения всех, но не получен верный от- вет во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
	Владеть методикой анализа данных для проведения необходимых экономических расчетов; методами анализа информации для проведения расчетов по оценке финансовых рисков; навыками работы с информацией по выявлению и анализу рисков.	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы	Продемон- стр ирован верный ход решения всех, но не получен верный от- вет во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
ПК-10	Знать методы составления прогноза основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом; основные источники информации, используемые в прогнозировании.	Тест	Выполнени е теста на 90- 100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правиль- ных ответов
	Уметь систематизировать	Решение	Задачи ре-	Продемон-	Продемонстр	Задачи не

F	1.5				1	
	наблюдаемые явления и про-	стандартны	шены в	стр ирован	ирован вер-	решены
	цессы с целью разработки	Х	полном объеме и	верный ход	ный ход ре-	
	прогнозов; осуществлять эф-	практически		решения	шения в	
	фективный поиск информации о состоянии	х задач	получены	всех, но не получен	большинстве	
	организации и результатах ее		верные ответы	верный от-	задач	
	деятельности; использовать		ОТВСТЫ	верный от-		
	методы прогнозирования в					
	процессе разработки			задачах		
	стратегий развития бизнеса;					
		Решение	20 1101111 120	Продолог	Продологото	Задачи не
	Владеть методологическими		Задачи ре-	Продемон-	Продемонстр	
	правилами и приемами сце-	прикладных	шены в	стр ирован	ирован вер-	решены
	нарного прогнозирования;	задач в	полном	верный ход	ный ход ре-	
	методами оценки альтерна-	конкретной	объеме и	решения	шения в	
	тивных прогнозов основных	предметной области	получены	всех, но не	большинстве	
	социально-экономических	ооласти	верные	получен	задач	
	показателей деятельности		ответы	верный от-		
	предприятия, отрасли, реги-			вет во всех		
ппи о	она и экономики в целом.	Т	D	задачах	D	D
ДПК-2	Знать нормативно-правовую	Тест		Выполнение	Выполнение	В тесте
	базу, регламентирующую		е теста на	теста на 80-	теста на 70-	менее 70%
	деятельность предприятия в		90- 100%	90%	80%	правиль-
	различных организационно-					ных отве-
	правовых формах и сферах					TOB
	деятельности.	D	n		TT	2
	Уметь осуществить выбор	Решение	Задачи ре-	Продемон-	Продемонстр	Задачи не
	наиболее эффективной орга-	стандартны	шены в	стр ирован	ирован вер-	решены
	низационно-правовой формы	X	полном	верный ход	ный ход ре-	
	для минимизации уровня не-	практически	объеме и	решения	шения в	
	определенности.	х задач	получены	всех, но не	большинстве	
			верные	получен	задач	
			ответы	верный от-		
				вет во всех		
		_		задачах	_	
	Владеть способностью при-	Решение	Задачи ре-	Продемон-	Продемонстр	Задачи не
	менения баз данных и ин-	прикладных	шены в	стр ирован	ирован вер-	решены
	формационных систем при	задач в	полном	верный ход	ный ход ре-	
	реализации организацион-	конкретной	объеме и	решения	шения в	
	но-управленческих функций в		получены	всех, но не	большинстве	
	целях анализа финансовых	области	верные	получен	задач	
	рисков		ответы	верный от-		
				вет во всех		
				задачах		
ОК-1	Знать методы анализа и син-	Тест	11)		Выполнение	13
		1001		Выполнение		В тесте
1	теза	1001	е теста на	теста на 80-	теста на 70-	менее 70%
	теза информации	1661				менее 70% правиль-
		1001	е теста на	теста на 80-	теста на 70-	менее 70% правиль- ных отве-
	информации		е теста на 90- 100%	теста на 80- 90%	теста на 70- 80%	менее 70% правиль- ных отве- тов
	информации Уметь абстрактно мыслить;	Решение	е теста на 90- 100% Задачи ре-	теста на 80-90%	теста на 70- 80% Продемонстр	менее 70% правильных ответов Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать		е теста на 90- 100%	теста на 80- 90% Продемон- стр ирован	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер-	менее 70% правиль- ных отве- тов
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследо-	Решение стандартны х	е теста на 90- 100% Задачи решены в полном	теста на 80- 90% Продемон- стр ирован верный ход	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер- ный ход ре-	менее 70% правильных ответов Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать	Решение стандартны	е теста на 90- 100% Задачи решены в	теста на 80- 90% Продемон- стр ирован верный ход решения	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в	менее 70% правильных ответов Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследо-	Решение стандартны х	е теста на 90- 100% Задачи решены в полном объеме и получены	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер- ный ход ре-	менее 70% правильных ответов Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследо-	Решение стандартны х практически	е теста на 90- 100% Задачи решены в полном объеме и	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в	менее 70% правильных ответов Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследо-	Решение стандартны х практически	е теста на 90- 100% Задачи решены в полном объеме и получены	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве	менее 70% правильных ответов Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследо-	Решение стандартны х практически	адачи решены в полном объеме и получены верные	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве	менее 70% правильных ответов Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследо-	Решение стандартны х практически	адачи решены в полном объеме и получены верные	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен верный от-	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве	менее 70% правильных ответов Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследо-	Решение стандартны х практически	адачи решены в полном объеме и получены верные	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве	менее 70% правильных ответов Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследо- вания информацию.	Решение стандартны х практически х задач	е теста на 90- 100% Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах	теста на 70- 80% Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	менее 70% правильных ответов Задачи не решены
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследования информацию. Владеть способностью к аб-	Решение стандартны х практически х задач	е теста на 90- 100% Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы Задачи ре-	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах Продемон-	теста на 70- 80% Продемонстр ирован верный ход решения в большинстве задач	менее 70% правильных ответов Задачи не решены Задачи не
	информации Уметь абстрактно мыслить; анализировать и обобщать полученную в ходе исследования информацию. Владеть способностью к абстрактному	Решение стандартны х практически х задач Решение прикладных	адачи решены в полном объеме и получены верные ответы Задачи решены в	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах Продемонстр ирован	теста на 70- 80% Продемонстр ирован верный ход решения в большинстве задач Продемонстр ирован вер-	менее 70% правильных ответов Задачи не решены Задачи не

		области	верные ответы	получен верный ответ во всех задачах	задач	
ОК-2	Знать основные приемы действий в нестандартных бизнес-ситуациях; содержание социальной и этической ответственности при принятии бизнес-решений.	Тест	Выполнени е теста на 90- 100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правиль- ных отве- тов
	Уметь действовать в нестандартных ситуациях; нести социальную и этическую ответственность за принятые управленческие решения.	Решение стандартны х практически х задач	Задачи ре- шены в полном объеме и получены верные ответы	Продемонстр ирован верный ход решения всех, но не получен верный ответ во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
	Владеть методиками и тех- нологиями действий в не- стандартных биз- нес-ситуациях.	Решение прикладных задач в конкретной предметной области	Задачи ре- шены в полном объеме и получены верные ответы	Продемон- стр ирован верный ход решения всех, но не получен верный от- вет во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
ОПК-3	Знать виды управленческих решений и методы их принятия; принципы построения организационных структур и распределения функций управления.	Тест	Выполнени е теста на 90- 100%	Выполнение теста на 80-90%	Выполнение теста на 70-80%	В тесте менее 70% правиль- ных отве- тов
	Уметь организовывать командное взаимодействие для решения задач в части анализа и управления рисками; воздействовать на персонал различными методами для достижения целей организации; разрабатывать и принимать оптимальные решения; организовывать их реализацию и контроль за исполнением решений; управлять работой производственного коллектива и работать в команде.	Решение стандартны х практически х задач	Задачи решены в полном объеме и получены верные ответы	Продемон- стр ирован верный ход решения всех, но не получен верный от- вет во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены
	Владеть методами реализации основных управленческих функций (принятие решений, организация, мотивирование и контроль) в вопросах снижения степени неопределенности	прикладных задач в конкретной предметной области	Задачи ре- шены в полном объеме и получены верные ответы	Продемон- стр ирован верный ход решения всех, но не получен верный от- вет во всех задачах	Продемонстр ирован вер- ный ход ре- шения в большинстве задач	Задачи не решены

7.2 Примерный перечень оценочных средств (типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности)

7.2.1 Примерный перечень заданий для подготовки к тестированию

- 1.В список крупнейших банков, хеджевых фондов, институциональных инвесторов, обанкротившихся в течение последних 20 лет, входят:
- A) Barings Bank
- Б) Bank of America
- B) Lehman Brothers
- Γ) Northern Rock
- Д) Холдинг MF Global
- 2. Установите соответствие:

Инфляционный риск	A) Нежелательное изменение валютного курса
Валютный риск	Б) Снижение покупательной способности денег
Правовой риск	В) Изменение налогового законодательства и других правовых норм, правил надзорных банковских органов

- 3.«Риск» в страховании по своей сущности не определяется как:
- А) выплата страховой суммы при наступлении страхового события
- Б) стоимость объекта, которая учитывается при страховании
- В) вероятность наступления страхового случая
- Г) конкретный объект страхования или предполагаемое вероятное событие, на случай наступления которого проводится страхование
- Д) фонд, формируемый за счет страховых взносов для целей страховых выплат
- 4.По источникам возникновения выделяют группы финансово-банковских рисков:
- А) рыночный, кредитный, риск ликвидности
- Б) рыночный, кредитный, операционный, правовой
- В) рыночный, кредитный, операционный, правовой, страновой
- Г) рыночный, кредитный, операционный, правовой, страновой, риск ликвидности
- Д) рыночный, кредитный, операционный, правовой, страновой, риск ликвидности, риск колебаний цен товаров
- 5. Продолжите предложение. При росте рыночной процентной ставки, стоимость активов с фиксированной доходностью...:
- А) растет
- Б) падает
- В) остается неизменной
- 6.Продолжите предложение. При снижении рыночной процентной ставки, стоимость активов с фиксированной доходностью...:
- А) растет

- Б) падает
- В) остается неизменной
- 7. Виды рыночного риска:
- А) процентный
- Б) валютный
- В) риск колебаний рыночных цен товаров
- Г) риск колебаний цен акций и производных финансовых инструментов
- Д) суверенный риск
- 8.Выберите неверное утверждение о сущности кредитного риска:
- А) риск изменения кредитного статуса контрагента, заемщика или эмитента финансового инструмента
- Б) риск отрицательного воздействия рыночных факторов
- Г) риск дефолта (неспособности или нежелания контрагента отвечать по своим обязательствам)
- Д) риск изменения кредитоспособности и надежности контрагента, эмитента ценных бумаг и обязательств
- 9.Выберите верное утверждение:
- А) Наиболее надежными с наименьшим кредитным риском считаются государственные обязательства
- Б) Наиболее надежными с наименьшей вероятностью отказа от выплаты процентов и дефолта считаются ценные бумаги коммерческих институтов 10.Операционный риск называют также:
- А) управленческим
- Б) риском недостаточности (ошибочности) информации
- В) эмпирическим
- Г) техническим
- Д) контрольным

7.2.2 Примерный перечень заданий для решения стандартных задач

1. Имеются два варианта вложения капитала. Установлено, что при вложении капитала в мероприятие А получение прибыли в сумме 15 млн р. имеет вероятность 0,6, а в мероприятие В получение прибыли в сумме 20 млн р. – вероятность 0,4.

Определите ожидаемое получение прибыли от вложения капитала (математическое ожидание) и рассмотрите вероятность наступления события объективным и субъективным методами.

2. Оцените варианты финансовых вложений инвестора, с целью минимизации риска, используя методику вероятного распределения доходности.

Имеется два альтернативных варианта финансовых вложений с характеристиками, представленными в таблице.

Таблица. Характеристики финансовых инструментов

Показатели	Ва- рианты влож ений		Вероятность осу- ществления, %
1. Рыночная цена ценной бумаги, тыс. р.	4	9	
2. Экспертная оценка доходности:			
2.1. пессимистическая			25
2.2. наиболее вероятная	1	2	60
2.3. оптимистическая	4	5	15

3. Определите среднюю ожидаемую прибыль, ожидаемую стоимость информации при условиях определенности и неопределенности, а также стоимость полной информации.

Если предприниматель стоит перед выбором, сколько ему закупить товара: 100 или 200 единиц. При закупке 100 единиц товара затраты составят 120 тыс. р. за единицу, а при закупке 200 единиц — 100 тыс. р. за единицу. Предприниматель данный товар будет продавать по 180 тыс. р. за единицу. Однако он не знает, будет ли спрос на него. Весь не проданный в срок товар может быть реализован только по цене 90 тыс. р. и менее. При продаже товара вероятность составляет «50 на 50», т.е. существует вероятность 0,5 для продажи 100 единиц товара и 0,5 для продажи 200 единиц товара.

4. Хозяйствующий субъект планирует осуществить через три месяца платежи в сумме 10 тыс. долл. США. При этом он отказался от хеджирования валютных рисков. В данный момент курс спот составляет 25,00 р. за 1 долл. Следовательно, затраты на покупку 10 тыс. долл. составят 250 тыс. р.

Рассмотрите, в чем проявляется преимущество, а в чем недостаток отказа от хеджирования. Определите потенциальную прибыль (экономию денежных средств) и дополнительные затраты на покупку валюты. Если через три месяца курс доллара понизится до 24,80 р. за 1 долл. Если через три месяца курс спот

5. Предприятие-заемщик заключило договор страхования риска непогашения кредита со страховой компанией. Кредит взят в сумме 120 млн р. под 40% годовых с 1.01.2017 по 31.12.2017 г. Погашение кредита и процентов по нему согласно кредитного договора должно осуществляться раз в полугодие. Заемщик оказался не в состоянии вернуть последний платеж и проценты по нему. Предел ответственности 70%. Страховой тариф 5,2%.

Определите страховую сумму, сумму страховых платежей и потерь по кредитному риску (сумму страхового возмещения в результате наступления страхового случая).

- 6. Банк заключил договор страхования риска непогашения кредита со страховой компанией. Банк-страхователь выдал кредит на 80 млн р. под 46% годовых. Предел ответственности 70%. Страховой тариф 6,8%. Заемщик оказался не в состоянии выплатить проценты за кредит. Кредитный договор заключен на срок с 1 января 2017 по 31 июня 2017 года.
- 7. Владелец груза стоимостью 500 млн р. застраховал его в страховой компании. Владелец предпочел вариант страхования без ответственности за повреждение. Процент страхового возмещения определен в 70%. В результате стихийного бедствия часть груза погибла (100 млн р.). Часть груза повреждена (25 млн р.). Страховой тариф 5%.

Определите страховую сумму, сумму страховых платежей и сумму потерь (сумму страхового возмещения) в результате наступления страхового случая.

- 8. Определите текущую ценность будущей потребности или сумму денежных средств необходимую для вложения сейчас, чтобы через три года получить 1500 у.е. Основанием для расчета является дисконтирование будущих доходов к современному моменту. Фиксированная норма прибыли из расчета 8% годовых.
- 9 Рассмотрите вложение в 1000 у.е., которое станет 1500 у.е. через три года при условии годовой ставки дисконта в 8%. Определите, выгодно ли данное вложение путем расчета чистой дисконтированной стоимости.
- 10. Определите наилучший вариант инвестирования (вложения средств), рассчитав для каждого случая чистую дисконтированную стоимость.

Даны три варианта единовременного вложения определенной суммы. По первому варианту через два года будет получено 1500 у.е., по второму варианту – 1700 у.е. через три года и по третьему варианту – 2000 у.е. через пять

7.2.3 Примерный перечень заданий для решения прикладных задач

- -Статистические методы оценки риска
- -Метод экспертных оценок рисков
- -Портфельный подход к оценке рисков
- -Принятие решений в условиях неопределенности и риска
- -Способы снижения рисков:
- страхование и системы страхового обеспечения
- -Методы управления финансовыми рисками
- -Содержание риск-менеджмента в организации
- -Рыночные риски и методика их комплексной оценки VAR (Value at risk)
- -Риски снижения ликвидности и платежеспособности
- -Риски снижения финансовой устойчивости
- -Инвестиционные риски организации

7.2.4 Примерный перечень вопросов для подготовки к зачету

- 1. Сущность риска, основные элементы, причины возникновения.
- 2. Объекты и субъекты риска.
- 3. Факторы риска.
- 4. Виды ущерба от риска.
- 5. Характеристика системы управления рисками. Суть, причины, процедуры и форма управления рисками. Задачи, решаемые при управлении рисками, правила риск-менеджмента.
- 6. Основные принципы управления риском (избежание, снижение, принятие, отказ). Этапы процесса управления риском (выявление и оценка, сравнение методов воздействия на риск, выбор методов воздействия на риск)
- 7. Методы выявления риска. Опросные листы, карты потоков, прямая инспекция, анализ финансовой и управленческой отчетности. Сущность и роль в оценке риска.
- 8. Суть и методы идентификации риска. Ценности подверженные рискам. Выявление факторов риска.
- 9. Статистические и вероятностные подходы к количественной оценке риска. Дисперсия и вариация как меры риска. Использование распределений Пуассона, Бернулли, Гаусса, Больцмана для оценки риска.
- 10. Построение профилей риска. Методы определения зон риска. Шкалы риска. Понятия и использование для оценки различных видов риска. Построения шкалы риска для оценки риска банкротства.
- 11. Специфические показатели, используемые для количественной оценки риска. Использование коэффициента β для оценки систематического риска.
- 12. Точка безубыточности, операционный и финансовый рычаг в оценке производственных и коммерческих рисков.

- 13. Коэффициенты ликвидности как измерители риска ликвидности на промышленных компаниях и финансовых институтах. Методы определения и управления рискамиликвидности.
- 14. Оценка риска банкротства через показатели деятельности предприятия. GAP-анализ, использование дюрации для управления процентным риском.
- 15. Экспертные процедуры, используемые при оценке риска. Риски, учитываемые с помощью экспертных процедур. Преимущества и недостатки экспертных оценок. Общая характеристика, используемые методы, общая схема экспертизы. Методы согласования экспертных оценок. Обработка результатов экспертных процедур.
- 16. Построение профиля рисков для оценки рисков компании.
- 17. Использование VaR для оценки ценности под риском.
- 18. Критерии выбора рисковых решений на основе ожидаемой доходности, ожидаемой полезности, функции рискового предпочтения.
- 19. Моделирование портфельных рисков. Сущность и методы управления риском различными классами инвесторов. Особенность применения бетта-коэффициентов в построении портфеля. Особенности управления портфельным риском в финансовой и производственной сфере.
- 20. Проблемы выбора рисковых решений на основе доходности и риска. Учет риска в оценке эффективности инвестиций.
- 21. Моделирование риска методом Монте-Карло. Показать особенности применение этого метода при оценке инвестиционного риска.
- 22. Учет риска при принятии управленческих решений в условиях неопределенности. Методы Лапласса, Вальда, Сэвиджа, Гурвица
- 23. Хеджирование рисков. Использование производные инструменты. Для хеджирования финансовых рисков. Виды фьючерсных и опционных контрактов. Основные виды стратегий хеджирования.
- 24. Технология хеджирование ценовых, валютных и процентных рисков с помощью фьючерсов.
- 25. Способы определения коэффициентов хеджировани при хеджировании опционами и фьючерсами.
- 26. Методы использование свопов в хеджировании рисков
- 27. Методы использования опционов в хеджировании рисков. Дельта, гамма хеджирование.
- 28. Источники финансирования риска. Структура затрат при различных методах управления риском. Анализ эффективности методов управления риском общие подходы, экономические критерии .Использование технологии временной стоимости в оценке эффективности управления рисками.
- 29. Производственный риск. Причины возникновения, структура, сущность, методы управления. Организация управления производственным риском. Риски неисполнения хозяйственных договоров. Риски усиления конкуренции. Риски возникновения непредвиденных расходов и сокращение доходов. Риски потери имущества предпринимательской организации. Риск невостребованности продукции. Промышленная безопасность. Управление рисками в промышленности. Модели оценки производственных рисков.

- 30. Финансовый риск. Причины возникновения, сущность, методы управления. Риски ликвидности в финансовых институтах. Механизмы управления ликвидностью. Инвестиционные риски, Процентные риски. Рыночные риски.
- 31. Инвестиционный риск. Закономерности управления инвестиционными проектами. Структура инвестиционных рисков. Технологии учета риска проекта. Проблемы количественной оценки риска проекта. Отражение риска проекта в дисконтных ставках. Методы построения ставки дисконта. Проблемы страхования инвестиционных рисков. Практика страхования инвестиционных рисков.
- 32. Политический риск. Причины возникновения, сущность, методы управления. Модели оценки политических рисков.
- 33. Кредитный риск при коммерческом и банковском кредитовании. Метод учета и управления. Модели оценки политических рисков
- 34. Валютный риск. Причины возникновения, сущность, методы управления в сфере производства и сбыта.
- 35. Операционный риск. Причины возникновения, сущность, методы управления и моделирования.
- 36. Современная концепция риск-менеджмента.
- 37. Отношение к риску. Современные теории исследующие поведение субъекта в ситуации риска.
- 38. Концепция приемлемого риска. Границы риск-менеджмента.
- 39. Модель управления риском.
- 40. Система управления рисками. Принципы построения систем управления рисками
- 41. Опыт построения систем управления рисками

7.2.5 Примерный перечень заданий для решения прикладных задач Укажите вопросы для экзамена

7.2.6. Методика выставления оценки при проведении промежуточной аттестации

(Например: Экзамен проводится по тест-билетам, каждый из которых содержит 10 вопросов и задачу. Каждый правильный ответ на вопрос в тесте оценивается 1 баллом, задача оценивается в 10 баллов (5 баллов верное решение и 5 баллов за верный ответ). Максимальное количество набранных баллов – 20.

- 1. Оценка «Неудовлетворительно» ставится в случае, если студент набрал менее 6 баллов.
- 2. Оценка «Удовлетворительно» ставится в случае, если студент набрал от 6 до 10 баллов
- 3. Оценка «Хорошо» ставится в случае, если студент набрал от 11 до 15 баллов.
- 4. Оценка «Отлично» ставится, если студент набрал от 16 до 20 баллов.)

7.2.7 Паспорт оценочных материалов

	7.2.7 паспорт оценоч	пых материа	WIOD
		Код	
№ п/п	Контролируемые разделы (темы)	контролируем	Наименование
312 11/11	дисциплины	ой	оценочного средства
		компетенции	
1	Основы теории управления риском	ДПК-5, ОК-3,	Тест, защита курсовой
		ПК- 5, ПК-6,	работы
		ПК-8, ПК- 9,	
		ПК-10, ДПК-2,	
		ОК-1, ОК-2,	
		ОПК- 3	
2	Основы риск-менеджмента.	ДПК-5, ОК-3,	Тест, защита курсовой
		ПК- 5, ПК-6,	работы
		ПК-8, ПК- 9,	
		ПК-10, ДПК-2,	
		OK-1, OK-2,	
		ОПК- 3	
3	Методы определения и оценки риска.	ДПК-5, ОК-3,	Тест, защита курсовой
		ПК- 5, ПК-6,	работы
		ПК-8, ПК- 9,	
		ПК-10, ДПК-2,	
		OK-1, OK-2,	
		ОПК- 3	
4	Организация управления рисками	ДПК-5, ОК-3,	Тест, защита курсовой
		ПК- 5, ПК-6,	работы
		ПК-8, ПК- 9,	
		ПК-10, ДПК-2,	
		OK-1, OK-2,	
		ОПК- 3	
5	Практика построения систем управления	ДПК-5, ОК-3,	Тест, защита курсовой
		ПК- 5, ПК-6,	работы
		ПК-8, ПК- 9,	
		ПК-10, ДПК-2,	
		OK-1, OK-2,	
		ОПК- 3	
6	Типовые решения управления риском в	ДПК-5, ОК-3,	Тест, защита курсовой
	различных	ПК- 5, ПК-6,	работы
	областях	ПК-8, ПК- 9,	
		ПК-10, ДПК-2,	
		OK-1, OK-2,	
		ОПК- 3	
	•	•	

7.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

Тестирование осуществляется, либо при помощи компьютерной системы тестирования, либо с использованием выданных тест-заданий на бумажном носителе. Время тестирования 30 мин. Затем осуществляется проверка теста экзаменатором и выставляется оценка согласно методики вы-

ставления оценки при проведении промежуточной аттестации.

Решение стандартных задач осуществляется, либо при помощи компьютерной системы тестирования, либо с использованием выданных задач на бумажном носителе. Время решения задач 30 мин. Затем осуществляется проверка решения задач экзаменатором и выставляется оценка, согласно методики выставления оценки при проведении промежуточной аттестации.

Решение прикладных задач осуществляется, либо при помощи компьютерной системы тестирования, либо с использованием выданных задач на бумажном носителе. Время решения задач 30 мин. Затем осуществляется проверка решения задач экзаменатором и выставляется оценка, согласно методики выставления оценки при проведении промежуточной аттестации.

Защита курсовой работы, курсового проекта или отчета по всем видам практик осуществляется согласно требованиям, предъявляемым к работе, описанным в методических материалах. Примерное время защиты на одного студента составляет 20 мин.

8 УЧЕБНО МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ)

8.1 Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

- 1. Буренин, А.Н. Задачи с решениями по рынку ценных бумаг, срочному рынку и риск-менеджменту. 3-е изд., испр / А.Н. Буренин. М.: НТО им. Вавилова, 2012. 380 с.
- 2. Вяткин, В.Н. Риск-менеджмент: учебник / В.Н. Вяткин, В.А. Гамза, Ф.В. Маевский. Люберцы: Юрайт, 2016. 353 с.
- 3. Деревяго, И.П. Менеджмент риска и страхования: Ответы на экзаменационные вопросы / И.П. Деревяго... Мн.: ТетраСистемс, 2009. 112 с.
- 4. Ермасова, Н.Б. Риск-менеджмент организации: Учебно-практическое пособие / Н.Б. Ермасова. М.: Дашков и К, 2013. 380 с.
- 5. Ермасова, Н.Б. Риск-менеджмент организации: Учебно-практическое пособие / Н.Б. Ермасова. М.: ИТК Дашков и К, 2014. 380 с.
- 6. Кирюшкин, В.Е. Основы риск-менеджмента / В.Е. Кирюшкин. М.: Анкил, 2009. 132 с.
- 7. Ковалев, П.П. Банковский риск-менеджмент: Учебное пособие / П.П. Ковалев. М.: КУРС, НИЦ ИНФРА-М, 2013. 320 с.
- 8. Круи, М. Основы риск-менеджмента / М. Круи, Д. Галай, Р. Марк. Люберцы: Юрайт, 2015. 390 с.
- 9. Кудрявцев, А.А. Интегрированный риск-менеджмент: учебник / А.А. Кудрявцев. М.: Экономика, 2010. 655 с.
- 10. Кудрявцев, А.А. Интегрированный риск-менеджмент / А.А. Кудрявцев. М.: Экономика, 2010. 655 с.
- 11. Фомичев, А.Н. Риск-менеджмент: Учебник для бакалавров, 4-е изд.(изд:4) / А.Н. Фомичев. М.: ИТК Дашков и К, 2016. 372 с.
- 12. Шаталова, Е.П. Оценка кредитоспособности заемщиков в банковском риск-менеджменте: Учебное пособие / Е.П. Шаталова. М.: КноРус, 2012. —

168 c.

- 13. Риск-менеджмент инвестиционного проекта. Учебник. Гриф УМЦ «Профессиональный учебник» / Под ред. М.В. Грачевой, А.Б. Секерина. М.: ЮНИТИ, 2013. 544 с.
- 8.2 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень лицензионного программного обеспечения, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

Каталог АРБИКОН (Ассоциации Региональных Библиотечных Консорциумов), «Строй Консультант», правовая система «Гарант», Интернет.

9 МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКАЯ БАЗА, НЕОБХОДИМАЯ ДЛЯ ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА

Материально-техническое обеспечение дисциплины включает:

- лекционную аудиторию, оборудованную экраном для показа слайдов через проектор;
- специализированные классы, оснащенные персональными компьютерами с выходом в интернет;
 - гуманитарный зал при библиотеке ВГТУ.

оборудование: видеопроекторы, компьютеры, слайды, кино- и видеофильмы.

10. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

По дисциплине «Анализ финансовых рисков» читаются лекции, проводятся практические занятия, выполняется курсовая работа.

Основой изучения дисциплины являются лекции, на которых излагаются наиболее существенные и трудные вопросы, а также вопросы, не нашедшие отражения в учебной литературе.

Практические занятия направлены на приобретение практических навыков выявления финансовых рисков и управления ими. Занятия проводятся путем решения конкретных задач в аудитории.

Методика выполнения курсовой работы изложена в учебно-методическом пособии. Выполнять этапы курсовой работы должны своевременно и в установленные сроки.

Контроль усвоения материала дисциплины производится проверкой курсовой работы, защитой курсовой работы.

Вид учебных занятий	Деятельность студента
Лекция	Написание конспекта лекций: кратко, схематично, последо-
	вательно фиксировать основные положения, выводы, фор-
	мулировки, обобщения; помечать важные мысли, выделять
	ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с

	,
	помощью энциклопедий, словарей, справочников с выпи-
	сыванием толкований в тетрадь. Обозначение вопросов,
	терминов, материала, которые вызывают трудности, поиск
	ответов в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно
	не удается разобраться в материале, необходимо сформу-
	лировать вопрос и задать преподавателю на лекции или на
	практическом занятии.
Практическое	Конспектирование рекомендуемых источников. Работа с
занятие	конспектом лекций, подготовка ответов к контрольным во-
	просам, просмотр рекомендуемой литературы. Прослуши-
	вание аудио- и видеозаписей по заданной теме, выполнение
	расчетно-графических заданий, решение задач по алгоритму.
Самостоятельная работа	Самостоятельная работа студентов способствует глубокому
	усвоения учебного материала и развитию навыков самооб-
	разования. Самостоятельная работа предполагает следую-
	щие составляющие:
	- работа с текстами: учебниками, справочниками, дополни-
	тельной литературой, а также проработка конспектов лек-
	ций;
	- выполнение домашних заданий и расчетов;
	- работа над темами для самостоятельного изучения;
	- участие в работе студенческих научных конференций,
	олимпиад;
	- подготовка к промежуточной аттестации.
Подготовка к	Готовиться к промежуточной аттестации следует система-
промежуточной аттестации	тически, в течение всего семестра. Интенсивная подготовка
_	должна начаться не позднее, чем за месяц-полтора до про-
	межуточной аттестации. Данные перед зачетом с оценкой,
	зачетом с оценкой три дня эффективнее всего использовать
	для повторения и систематизации материала.