

**ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ
ПО ДИСЦИПЛИНЕ**
Современный риск-менеджмент

Код модуля
1161459(1)

Модуль
Обеспечение организационной подготовки
проекта

Екатеринбург

Оценочные материалы составлены автором(ами):

№ п/п	Фамилия, имя, отчество	Ученая степень, ученое звание	Должность	Подразделение
1	Долгих Юлия Александровна	кандидат экономических наук, доцент	Доцент	финансов, денежного обращения и кредита

Согласовано:

Управление образовательных программ

И.Ю. Русакова

Авторы:

- Долгих Юлия Александровна, Доцент, финансов, денежного обращения и кредита

1. СТРУКТУРА И ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ Современный риск-менеджмент

1.	Объем дисциплины в зачетных единицах	3	
2.	Виды аудиторных занятий	Лекции Практические/семинарские занятия	
3.	Промежуточная аттестация	Экзамен	
4.	Текущая аттестация	Контрольная работа	1
		Домашняя работа	1

2. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ (ИНДИКАТОРЫ) ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ Современный риск-менеджмент

Индикатор – это признак / сигнал/ маркер, который показывает, на каком уровне обучающийся должен освоить результаты обучения и их предьявление должно подтвердить факт освоения предметного содержания данной дисциплины, указанного в табл. 1.3 РПМ-РПД.

Таблица 1

Код и наименование компетенции	Планируемые результаты обучения (индикаторы)	Контрольно-оценочные средства для оценивания достижения результата обучения по дисциплине
1	2	3
УК-1 -Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	З-2 - Определять этапы разработки стратегии действий и методы решения проблемных ситуаций П-1 - Использовать эффективные стратегии действий для решения проблемной ситуации с учетом оценки ограничений, рисков и моделируемых результатов У-2 - Обосновывать выбор стратегии для достижения поставленной цели с учетом ограничений, рисков и моделируемых результатов У-3 - Анализировать проблемную ситуацию, выявлять и определять способы ее разрешения	Домашняя работа Контрольная работа Лекции Практические/семинарские занятия Экзамен

<p>УК-2 -Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла</p>	<p>З-1 - Демонстрировать понимание процессов управления проектом, планирования ресурсов, критерии оценки рисков и результатов проектной деятельности П-2 - Выбирать оптимальные способы решения конкретных задач проекта на каждом этапе его реализации на основе анализа и оценки рисков и их последствий с учетом ресурсов и ограничений У-3 - Анализировать и оценивать риски и результаты проекта на каждом этапе его реализации и корректировать проект в соответствии с критериями, ресурсами и ограничениями</p>	<p>Домашняя работа Контрольная работа Лекции Практические/семинарские занятия Экзамен</p>
<p>ПК-3 -Способен осуществлять деятельность по управлению сроками и рисками проектов, контролю текущих и промежуточных результатов</p>	<p>З-1 - Характеризовать виды и процедуры контроля выполнения проекта З-2 - Характеризовать методы выявления и оценки рисков, определения вероятности их воздействия, принципы и методы управления рисками З-3 - Демонстрировать понимание методов разработки и реализации программ управления рисками П-1 - Организовывать систему контроля реализации проекта, планировать сроки и управлять сроками проекта П-2 - Осуществлять мониторинг и управление исполнением обязательств по проекту, оценивать соответствие промежуточных результатов принятым обязательствам по проекту П-3 - Оценивать и ранжировать выявленные риски по вероятности и степени влияния на результат проекта и разрабатывать мероприятия по управлению ими</p>	<p>Домашняя работа Контрольная работа Лекции Практические/семинарские занятия Экзамен</p>

	<p>У-1 - Анализировать фактические результаты проекта, контролировать текущие промежуточные результаты по проекту, внедрять корректирующие воздействия</p> <p>У-2 - Определять сроки реализации проекта и разрабатывать рабочий план-график контроля исполнения обязательств по проекту, выявлять отклонения и анализировать их причины</p> <p>У-3 - Выбирать методы и инструменты управления рисками</p> <p>У-4 - Выявлять и оценивать степень (уровень) риска проекта, в том числе с использованием программных инструментов, разрабатывать матрицу рисков и мероприятия по управлению ими</p>	
<p>ПК-8 -Способен анализировать нормативно-правовые акты, международные, национальные и отраслевые стандарты в профессиональной сфере, использовать правоприменительную практику и разрабатывать локальные нормативные акты</p>	<p>З-1 - Объяснять порядок использования в профессиональной деятельности нормативно-правовых актов, международных, национальных и отраслевых стандартов, правоприменительной практики</p> <p>П-1 - Применять нормативно-правовые акты, международные, национальные и отраслевые стандарты в профессиональной деятельности</p> <p>У-1 - Идентифицировать и оценивать правовые риски, возникающие при реализации проекта</p>	<p>Домашняя работа</p> <p>Контрольная работа</p> <p>Лекции</p> <p>Практические/семинарские занятия</p> <p>Экзамен</p>

3. ПРОЦЕДУРЫ КОНТРОЛЯ И ОЦЕНИВАНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ В РАМКАХ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ В БАЛЬНО-РЕЙТИНГОВОЙ СИСТЕМЕ (ТЕХНОЛОГИЧЕСКАЯ КАРТА БРС)

3.1. Процедуры текущей и промежуточной аттестации по дисциплине

1. Лекции: коэффициент значимости совокупных результатов лекционных занятий – 0.5		
Текущая аттестация на лекциях	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
<i>домашняя работа</i>	3,	100
Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по лекциям – 0.5		
Промежуточная аттестация по лекциям – экзамен		
Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по лекциям – 0.5		
2. Практические/семинарские занятия: коэффициент значимости совокупных результатов практических/семинарских занятий – 0.5		
Текущая аттестация на практических/семинарских занятиях	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
<i>контрольная работа</i>	3,	100
Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по практическим/семинарским занятиям– 1		
Промежуточная аттестация по практическим/семинарским занятиям– нет		
Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по практическим/семинарским занятиям– не предусмотрено		
3. Лабораторные занятия: коэффициент значимости совокупных результатов лабораторных занятий –не предусмотрено		
Текущая аттестация на лабораторных занятиях	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по лабораторным занятиям - не предусмотрено		
Промежуточная аттестация по лабораторным занятиям – нет		
Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по лабораторным занятиям – не предусмотрено		
4. Онлайн-занятия: коэффициент значимости совокупных результатов онлайн-занятий –не предусмотрено		
Текущая аттестация на онлайн-занятиях	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по онлайн-занятиям - не предусмотрено		
Промежуточная аттестация по онлайн-занятиям – нет		
Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по онлайн-занятиям – не предусмотрено		

3.2. Процедуры текущей и промежуточной аттестации курсовой работы/проекта

Текущая аттестация выполнения курсовой работы/проекта	Сроки – семестр, учебная неделя	Максимальная оценка в баллах
Весовой коэффициент текущей аттестации выполнения курсовой работы/проекта– не предусмотрено		
Весовой коэффициент промежуточной аттестации выполнения курсовой работы/проекта– защиты – не предусмотрено		

4. КРИТЕРИИ И УРОВНИ ОЦЕНИВАНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ

4.1. В рамках БРС применяются утвержденные на кафедре/институте критерии (признаки) оценивания достижений студентов по дисциплине модуля (табл. 4) в рамках контрольно-оценочных мероприятий на соответствие указанным в табл.1 результатам обучения (индикаторам).

Таблица 4

Критерии оценивания учебных достижений обучающихся

Результаты обучения	Критерии оценивания учебных достижений, обучающихся на соответствие результатам обучения/индикаторам
Знания	Студент демонстрирует знания и понимание в области изучения на уровне указанных индикаторов и необходимые для продолжения обучения и/или выполнения трудовых функций и действий, связанных с профессиональной деятельностью.
Умения	Студент может применять свои знания и понимание в контекстах, представленных в оценочных заданиях, демонстрирует освоение умений на уровне указанных индикаторов и необходимых для продолжения обучения и/или выполнения трудовых функций и действий, связанных с профессиональной деятельностью.
Опыт /владение	Студент демонстрирует опыт в области изучения на уровне указанных индикаторов.
Другие результаты	Студент демонстрирует ответственность в освоении результатов обучения на уровне запланированных индикаторов. Студент способен выносить суждения, делать оценки и формулировать выводы в области изучения. Студент может сообщать преподавателю и коллегам своего уровня собственное понимание и умения в области изучения.

4.2 Для оценивания уровня выполнения критериев (уровня достижений обучающихся при проведении контрольно-оценочных мероприятий по дисциплине модуля) используется универсальная шкала (табл. 5).

Таблица 5

Шкала оценивания достижения результатов обучения (индикаторов) по уровням

Характеристика уровней достижения результатов обучения (индикаторов)		
№ п/п	Содержание уровня выполнения критерия оценивания результатов	Шкала оценивания

	обучения (выполненное оценочное задание)	Традиционная характеристика уровня		Качественная характеристика уровня
1.	Результаты обучения (индикаторы) достигнуты в полном объеме, замечаний нет	Отлично (80-100 баллов)	Зачтено	Высокий (В)
2.	Результаты обучения (индикаторы) в целом достигнуты, имеются замечания, которые не требуют обязательного устранения	Хорошо (60-79 баллов)		Средний (С)
3.	Результаты обучения (индикаторы) достигнуты не в полной мере, есть замечания	Удовлетворительно (40-59 баллов)		Пороговый (П)
4.	Освоение результатов обучения не соответствует индикаторам, имеются существенные ошибки и замечания, требуется доработка	Неудовлетворительно но (менее 40 баллов)	Не зачтено	Недостаточный (Н)
5.	Результат обучения не достигнут, задание не выполнено	Недостаточно свидетельств для оценивания		Нет результата

5. СОДЕРЖАНИЕ КОНТРОЛЬНО-ОЦЕНОЧНЫХ МЕРОПРИЯТИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ

5.1. Описание аудиторных контрольно-оценочных мероприятий по дисциплине модуля

5.1.1. Лекции

Самостоятельное изучение теоретического материала по темам/разделам лекций в соответствии с содержанием дисциплины (п. 1.2. РПД)

5.1.2. Практические/семинарские занятия

Примерный перечень тем

1. Управление рисками. Основные понятия
2. Сущность, факторы и классификация предпринимательских рисков
3. Производственные и коммерческие риски
4. Финансовые риски

Примерные задания

1. Постройте матрицу рисков
 2. Постройте реестр рисков
 3. Составьте план управления рисками
- LMS-платформа – не предусмотрена

5.2. Описание внеаудиторных контрольно-оценочных мероприятий и средств текущего контроля по дисциплине модуля

Разноуровневое (дифференцированное) обучение.

Базовый

5.2.1. Контрольная работа

Примерный перечень тем

1. Управление рисками. Основные понятия
2. Сущность, факторы и классификация предпринимательских рисков
3. Производственные и коммерческие риски
4. Финансовые риски

Примерные задания

1. В зависимости от используемых ресурсов различают потери:
 - 1) материальные, трудовые, информационные, временные
 - 2) относительные, трудовые, информационные, интеллектуальные
 - 3) случайные, материальные, трудовые, временные
 - 4) абсолютные, материальные, трудовые, информационные
2. В качестве меры риска актива используется ...
 - 1) доходность актива
 - 2) величина актива
 - 3) стандартное отклонение доходности актива
 - 4) дисперсия доходности актива
3. К признакам риска как экономической категории не относится:
 - 1) неопределенность
 - 2) альтернативность
 - 3) вероятность
 - 4) недетерминированность
4. По каким инвестициям ожидается наивысший уровень дохода:
 - 1) высокорисковые инвестиции
 - 2) среднерисковые инвестиции
 - 3) низкорисковые инвестиции
 - 4) безрисковые инвестиции
5. Какой из рисков не является систематическим:
 - 1) риск потенциальных убытков из-за изменения валютных курсов
 - 2) риск невозможности выполнения кредитного договора
 - 3) риск уменьшения капитализации из-за снижения цен на акции
 - 4) риск роста издержек обращения из-за изменения цен на сырье
6. Процентный риск, валютный риск, ценовой риск – это разновидности:
 - 1) рыночного риска
 - 2) операционного риска
 - 3) кредитного риска
 - 4) инвестиционного риска
7. Ценовой риск подразделяется на:
 - 1) фондовый и товарный
 - 2) процентный и валютный
 - 3) фондовый и валютный
 - 4) товарный и процентный
8. В каком случае управление финансовыми рисками на уровне организации будет иметь наибольший эффект:

- 1) если есть большие финансовые резервы
 - 2) если выделены большие сырьевые фонды
 - 3) если идентифицированы и оценены риски
 - 4) если есть желание рисковать у руководства
9. Методом «Монте-Карло» называют:
- 1) анализ сценариев
 - 2) имитационное моделирование
 - 3) стресс-тестирование
 - 4) кластерный анализ
10. К моделям оценки риска банкротства организации не относится:
- 1) модель Альтмана
 - 2) модель Бивера
 - 3) модель VaR
 - 4) модель Таффлера

1. Доходность рискованного актива равна 30%, актива без риска – 15%. Инвестор хотел бы сформировать кредитный портфель с доходностью 18%. Определите, в каких пропорциях ему следует приобрести рискованный актив и актив без риска?

2. Портфель инвестора состоит из акций А и В, ожидаемая доходность акции А – 25%, стандартное отклонение доходности – 20%; ожидаемая доходность акции В – 20%, стандартное отклонение – 15%. Коэффициент корреляции доходностей акций – 40%. Необходимо сформировать эффективный портфель (портфель с минимальным уровнем риска), то есть определить удельные веса активов А и В.

3. Произведите качественную оценку выявленных рисков посредством балльной оценки двух параметров каждого рискованного события: вероятности возникновения рискованного события; уровня влияния последствий рискованного события на рассматриваемую организацию. При осуществлении балльной оценки параметров рисков используйте предложенные пятибалльные шкалы

LMS-платформа – не предусмотрена

5.2.2. Домашняя работа

Примерный перечень тем

1. Управление рисками. Основные понятия
2. Сущность, факторы и классификация предпринимательских рисков
3. Производственные и коммерческие риски
4. Финансовые риски

Примерные задания

1. Эволюция развития риск-менеджмента
2. Количественные методы оценки риска
3. Экспертные методы оценки риска
4. Процедура и инструменты принятия решений в рискованных ситуациях
5. Организация системы риск-менеджмента

LMS-платформа – не предусмотрена

5.3. Описание контрольно-оценочных мероприятий промежуточного контроля по дисциплине модуля

5.3.1. Экзамен

Список примерных вопросов

1. Риск-менеджмент в системе управления организацией
 2. Структурные элементы процесса риск-менеджмента
 3. Подходы к определению понятия риск
 4. Классификация рисков
 5. Количественные методы оценки риска
 6. Экспертные методы оценки риска
 7. Сущность и виды предпринимательских рисков
 8. Методы оценки предпринимательских рисков
 9. Этапы анализа предпринимательских рисков
 10. Методы оценки производственных рисков
 11. Методы оценки потерь и методы управления коммерческими рисками
 12. Сущность и характеристики финансовых рисков
 13. Классификация финансовых рисков
 14. Несистематические финансовые риски
 15. Оценка и управление процентным риском
 16. Оценка валютного риска
 17. Методы хеджирования валютного риска
 18. Виды ценового риска
 19. Оценка и управление фондовым риском
 20. Оценка и управление товарным риском
 21. Кредитный риск
 22. Инвестиционный риск
 23. Инновационный риск
 24. Депозитный риск
 25. Риск ликвидности
 26. Риск банкротства
- LMS-платформа – не предусмотрена

5.4 Содержание контрольно-оценочных мероприятий по направлениям воспитательной деятельности

Направления воспитательной деятельности сопрягаются со всеми результатами обучения компетенций по образовательной программе, их освоение обеспечивается содержанием всех дисциплин модулей.