

**ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ  
ПО ДИСЦИПЛИНЕ**  
Оценка рисков

**Код модуля**  
1157429

**Модуль**  
Экономический анализ в деятельности эксперта

**Екатеринбург**

Оценочные материалы составлены автором(ами):

<b>№ п/п</b>	<b>Фамилия, имя, отчество</b>	<b>Ученая степень, ученое звание</b>	<b>Должность</b>	<b>Подразделение</b>
1	Городнова Наталья Васильевна	доктор экономических наук, доцент	Профессор	правового регулирования экономической деятельности

**Согласовано:**

Управление образовательных программ

.. Русакова И.Ю.

Авторы:

## 1. СТРУКТУРА И ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ **Оценка рисков**

1.	Объем дисциплины в зачетных единицах	3	
2.	Виды аудиторных занятий	Лекции Практические/семинарские занятия	
3.	Промежуточная аттестация	Зачет	
4.	Текущая аттестация	Контрольная работа	1
		Домашняя работа	1
		Собеседование/устный опрос	1
		Кейс-анализ	1

## 2. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ (ИНДИКАТОРЫ) ПО ДИСЦИПЛИНЕ МОДУЛЯ **Оценка рисков**

Индикатор – это признак / сигнал/ маркер, который показывает, на каком уровне обучающийся должен освоить результаты обучения и их предъявление 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
ПК-11 -Способен применять методы и методики экономических экспертиз и исследований в профессиональной деятельности	З-1 - Методы и методики экономических экспертиз и экономических исследований П-1 - Навык применения методов и методик экономических экспертиз и экономических исследований У-1 - Применение методов и методик экономических экспертиз и экономических исследований	Домашняя работа Зачет Кейс-анализ Контрольная работа Лекции Практические/семинарские занятия Собеседование/устный опрос
ПК-13 -Способен консультировать субъектов правоприменительной и правоохранительной	З-1 - Проблемы производства экономических экспертиз по уголовным, гражданским, административным делам и	Домашняя работа Зачет Кейс-анализ Контрольная работа Лекции

деятельности, сотрудников судебно-экспертных учреждений по вопросам производства экономических экспертиз и возможностям использования экономических знаний в правоохранительной деятельности	делам об административных правонарушениях З-2 - Результаты экономического анализа У-1 - Анализ проблем производства экономических экспертиз У-2 - Выработка путей решения проблем производства экономических экспертиз У-3 - Объяснение результатов экономического анализа и возможностей их использования в правоохранительной деятельности	Практические/семинарские занятия Собеседование/устный опрос
--	--	--

### 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

<b>1. Лекции: коэффициент значимости совокупных результатов лекционных занятий – 0.6</b>		
<b>Текущая аттестация на лекциях</b>	<b>Сроки – семестр, учебная неделя</b>	<b>Максимальная оценка в баллах</b>
<i>домашняя работа</i>	15	50
<i>устный опрос</i>	17	50
<b>Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по лекциям – 0.4</b>		
<b>Промежуточная аттестация по лекциям – зачет</b>		
<b>Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по лекциям – 0.6</b>		
<b>2. Практические/семинарские занятия: коэффициент значимости совокупных результатов практических/семинарских занятий – 0.4</b>		
<b>Текущая аттестация на практических/семинарских занятиях</b>	<b>Сроки – семестр, учебная неделя</b>	<b>Максимальная оценка в баллах</b>
<i>контрольная работа</i>	14	50
<i>кейс-анализ</i>	17	50
<b>Весовой коэффициент значимости результатов текущей аттестации по практическим/семинарским занятиям – 1</b>		
<b>Промежуточная аттестация по практическим/семинарским занятиям – нет</b>		
<b>Весовой коэффициент значимости результатов промежуточной аттестации по практическим/семинарским занятиям – не предусмотрено</b>		

<b>3. Лабораторные занятия: коэффициент значимости совокупных результатов лабораторных занятий –не предусмотрено</b>		
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		
<b>4. Онлайн-занятия: коэффициент значимости совокупных результатов онлайн-занятий –не предусмотрено</b>		
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 обучения (выполненное оценочное задание)	Шкала оценивания		
		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 (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. 1. Предмет и задачи дисциплины. 2. Особенности управления предприятием в рыночных условиях. 3. Общие принципы управления финансовыми рисками. 4. Инструментарий при анализе риска. 5. Методы оценки уровня риска. 6. Способы снижения уровня риска. 7. Учет рисков при финансировании проекта.

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. Примерный перечень вопросов к контрольной работе: 1. Основные объекты финансовых инвестиций и финансовых рисков. 2. Государственное регулирование рисков в бизнесе. 3. Экономические рычаги снижения рисков в бизнесе. 4. Финансово-экономические аспекты рисков в бизнесе. 5. Оценка риска ценных бумаг как источника финансирования. 6. Инвестиции: понятие, виды; управление инвестиционными рисками. 7. Учет инвестиционных рисков в деятельности эксперта.

Примерные задания

Контрольная работа проводится в форме письменного ответа на теоретический вопрос.

LMS-платформа – не предусмотрена

#### **5.2.2. Домашняя работа**

Примерный перечень тем

1. Примерная тематика домашних работ: 1. Понятие риска, способы определения риска. 2. Классификация и виды рисков. 3. Объекты капитальных вложений и субъекты инвестиционной деятельности. 4. Государственная инвестиционная политика в России. 5. Государственное регулирование инвестиционной деятельности. 6. Источники финансирования финансовой и инвестиционной деятельности. 7. Принятие инвестиционных решений. Оценка риска. 8. Методы оценки рисков и эффективности реальных инвестиционных проектов. 9. Принятие решений по финансовым инвестициям. Инвестиционные риски. 10. Оценка недвижимости и оценочная деятельность. 11. Оценка рисков инвестиций в недвижимость. 12. Особенности оценки рисков, связанных с объектами недвижимости. 13. Экономическая эффективность капитальных вложений.

Дисконтирование и риски. 14. Кредитные риски капитальных вложений. 15. Риски в инновационной деятельности. 16. Страхование как метод снижения рисков. 17. Экологические риски. 18. Геополитические риски. 19. Методы снижения уровня риска. 20. Оценка рисков в профессиональной деятельности эксперта.

Примерные задания

Домашняя работа проводится в письменной форме. Общий объем текста 20-25 страниц, шрифт Times New Roman 14, интервал 1,0 либо Times New Roman 12, интервал 1,5. Работа должна состоять из следующих разделов:

Введение, 1-2 страницы

1. Теоретические основы по выбранной тематике, 8-10 страниц.
2. Прикладное применение (приведение конкретных практических примеров в зарубежном опыте и отечественной практике), 8-10 страниц.
3. Заключение, 1-2 страницы
4. Список используемой литературы не менее 10 источников.

LMS-платформа – не предусмотрена

### **5.2.3. Собеседование/устный опрос**

Примерный перечень тем

1. 1. Предмет и задачи дисциплины. 2. Особенности управления предприятием в рыночных условиях. 3. Общие принципы управления финансовыми рисками. 4. Инструментарий при анализе риска. 5. Методы оценки уровня риска. 6. Способы снижения уровня риска. 7. Учет рисков при финансировании проекта.

Примерные задания

Устный опрос проводится на каждом практическом занятии; его тематика соответствует темам практических занятий.

LMS-платформа – не предусмотрена

### **5.2.4. Кейс-анализ**

Примерный перечень тем

1. Кейсы решаются на практическом занятии; их тематика соответствует темам практических занятий: 1. Предмет и задачи дисциплины. 2. Особенности управления предприятием в рыночных условиях. 3. Общие принципы управления финансовыми рисками. 4. Инструментарий при анализе риска. 5. Методы оценки уровня риска. 6. Способы снижения уровня риска. 7. Учет рисков при финансировании проекта.

Примерные задания



### Задача №1

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

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

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

### Задача №2

Задание. Составить прогноз годовой доходности по каждой альтернативе. В бланке выполнения задания необходимо заполнить таблицы 2, 3, 4.

Условие задания.

Владельцы автосервиса успешно ведут свой бизнес более 5 лет. Они сумели сделать значительные финансовые накопления, так как имеют хорошую репутацию и постоянных клиентов.

До настоящего момента стратегия на будущее не разрабатывалась, но теперь появились три альтернативы развития бизнеса по следующим направлениям: автомойка, магазин автозапчастей и мастерская шиномонтажа. Используя имеющийся опыт и анализируя текущую рыночную ситуацию, владельцам необходимо составить прогноз годовой доходности по каждой альтернативе (Таблица 1).

Таблица 1 – Годовая доходность альтернативных вариантов

Альтернативный вариант	Благоприятная рыночная ситуация, руб.	Неблагоприятная рыночная ситуация, руб.
Автомойка	1 400 000	700 000
Магазин автозапчастей	1 000 000	600 000
Мастерская шиномонтажа	500 000	400 000

Какой вариант следует выбрать владельцам в условиях: риска, если предположить, что вероятность неблагоприятной ситуации составляет 40%; абсолютной неопределенности?

### Задача №3

Оцените уровень операционных рисков компании на основе данных отчетности, представленных в таблице:

Показатель	2008	2009	Отклонение
Выручка от продаж, тыс. руб.	2880	2570	
Переменные издержки, тыс. руб.	1640	1870	
Постоянные издержки, тыс. руб.	121	122	
Маржинальная прибыль, тыс. руб.			
Операционная прибыль, тыс. руб.			
Доля маржинальной прибыли в выручке			
Выручка в точке безубыточности, тыс. руб.			
Запас финансовой прочности, тыс. руб.			
Запас финансовой прочности, %			
Эффект операционного рычага			

LMS-платформа – не предусмотрена

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

#### 5.3.1. Зачет

Список примерных вопросов

1. 1. Понятие неопределенности и риска, способы определения риска. 2. Классификация и виды рисков. 3. Способы оценки уровня риска. 4. Государственная инвестиционная политика в России. 5. Учет риска для государства. 6. Государственное регулирование инвестиционной деятельности. 7. Принятие инвестиционных решений. 8. Методы оценки риска. 9. Методы оценки рисков и эффективности реальных инвестиционных проектов. 10. Учет рисковой составляющей при оценке стоимости объектов. 11. Учет рисковой составляющей при процедуре дисконтирования денежных потоков. 12. Принятие решений по финансовым инвестициям. 13. Инвестиционные риски. 14. Понятие портфеля финансовых инвестиций. 15. Риск портфеля. 16. Оценка рисков инвестиций в недвижимость. 17. Особенности оценки рисков, связанных с объектами недвижимости. 18. Приращение, дисконтирование и риски при определении чистой текущей стоимости проекта. 19. Кредитные риски капитальных вложений. 20. Риски в инновационной деятельности. 21. Методы снижения уровня риска. 22. Учет рисков в деятельности эксперта.

LMS-платформа – не предусмотрена

### 5.4 Содержание контрольно-оценочных мероприятий по направлениям воспитательной деятельности

Направление воспитательной деятельности	Вид воспитательной деятельности	Технология воспитательной деятельности	Компетенция	Результаты обучения	Контрольно-оценочные мероприятия
Профессиональное воспитание	целенаправленная работа с информацией для использования в практических целях	Технология формирования уверенности и готовности к самостоятельной успешной профессиональной деятельности Технология самостоятельной работы	ПК-11	У-1	Домашняя работа Практические/семинарские занятия