

федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тольяттинский государственный университет»

Б1.В.09

(индекс дисциплины)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Риск-менеджмент

(наименование дисциплины)

по направлению подготовки (специальности)

38.03.01 Экономика

(код и наименование направления подготовки, специальности в соответствии с ФГОС ВО)

Бухгалтерский учёт, анализ и аудит

(направленность (профиль))

Форма обучения: заочная

Год набора: 2019

Распределение часов дисциплины по курсам и видам занятий (по учебному плану)

Количество ЗЕТ	5						
Часов по РУП	180						
Виды контроля на курсах	Экзамены	Зачеты		Курсовые проекты	Курсовые работы	Контрольные работы (для заочной формы обучения)	
	4						
	№№ курса						
	1	2	3	4	5	6	Итого
ЗЕТ по курсам				5			5
Лекции				4			4
Лабораторные							
Практические				4			4
Контактная работа				8,35			8,35
Сам. работа				163			163
Контроль				8,65			8,65
Итого				180			180

Тольятти, 2018

Рабочая программа составлена на основании ФГОС ВО и учебного плана направления подготовки (специальности) 38.03.01 Экономика

(код и наименование направления подготовки, специальности в соответствии с ФГОС ВО)

Рецензирование рабочей программы дисциплины:

☐

Отсутствует

☐

Учебная (рабочая) программа одобрена на заседании департамента бакалавриата (экономических и управленческих программ) (протокол заседания № 1 от «02» августа 2018 г.).

☐

Рецензент

(должность, ученое звание, степень)

«__» _____ 20__ г.

(подпись)

(И.О. Фамилия)

Срок действия рабочей программы дисциплины до «02» августа 2024 г.

Информация об актуализации рабочей программы дисциплины:

Протокол заседания департамента № 1 от «29» августа 2019г.

Протокол заседания департамента № 10а от «02» июня 2020г.

Протокол заседания департамента № ____ от «__» _____ 20__ г.

Протокол заседания департамента № ____ от «__» _____ 20__ г.

УТВЕРЖДАЮ

Руководитель департамента бакалавриата (экономических и управленческих программ)

«__» _____ 20__ г.

(подпись)

С.Е. Васильева

(И.О. Фамилия)

АННОТАЦИЯ

дисциплины (учебного курса)

Б1.В.09 Риск-менеджмент

(индекс и наименование дисциплины (учебного курса))

1. Цель и задачи изучения дисциплины (учебного курса)

Цель – ознакомить студентов с базовыми понятиями и навыками по обеспечению эффективного функционирования фирмы в условиях неопределенности с учетом изменения внутренних и внешних факторов предпринимательской среды, идентификации рискованных ситуаций и локализации имеющих место рисков, организации работы по оценке, анализу и управлению рисками и финансовыми отношениями, возникающими в процессе этого управления.

Задачи:

1. сформировать у студентов представление о методиках и их приемах;
2. дать представление о необходимых прогнозно-аналитических расчетных процедурах, связанных с диагностикой последствий реализации различных рисков и оценкой их возникновения;
3. раскрыть сущность основных направлений снижения негативных последствий рисков.

2. Место дисциплины (учебного курса) в структуре ОПОП ВО

Данная дисциплина (учебный курс) относится к Блоку 1. Дисциплины (модули).

Дисциплины, учебные курсы, на освоении которых базируется данная дисциплина (учебный курс) – «Экономика», «Инвестиции», «Финансы, денежное обращение и кредит».

Дисциплины, учебные курсы, для которых необходимы знания, умения, навыки, приобретаемые в результате изучения данной дисциплины (учебного курса) – «Банковское дело и кредитные институты», «Оценка стоимости активов» и др.

3. Планируемые результаты обучения по дисциплине (учебному курсу), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Формируемые и контролируемые компетенции	Планируемые результаты обучения
- Способностью выбирать	Знать: основные дискуссионные вопросы современной теории рисков; современное

инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы (ОПК-3)	законодательство, нормативные и методические документы, касающиеся предпринимательства, как в Российской Федерации, так и за рубежом; содержание основной отечественной и зарубежной монографической литературы по теоретическим вопросам, связанным с управлением рисков
	Уметь: применять полученные знания для количественной и качественной оценки риска; использовать правила и методы управления рисками с целью повышения эффективности предпринимательской деятельности.
	Владеть: методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; методами и приёмами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических моделей.
- Способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовностью нести за них ответственность (ОПК-4)	Знать: организационно-управленческие решения в области управления рисками.
	Уметь: принимать организационно-управленческие решения в области управления рисками.
	Владеть: методами и приемами принятия организационно-управленческих решений в области управления рисками.
- Способностью на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов (ПК-2)	Знать: существующие взаимозависимости показателей текущих и оперативных планов, прогнозов, расчетов к ним и отчетности для внесения своевременных взаимосвязанных коррективов.
	Уметь: анализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических показателей, характеризующих деятельность предприятия; анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений.
	Владеть: основными методами, способами и средствами получения, хранения, переработки информации.

Тематическое содержание дисциплины (учебного курса)

Раздел, модуль	Подраздел, тема
1. Теоретические основы риск-менеджмент	1.1. Экономическая сущность финансового риска и его классификации
	1.2. Сущность и содержание риск – менеджмента. Профессия риск-менеджера
	1.3. Сущность, цель и функции управления финансовыми рисками предприятия
	1.4. Системы обеспечения управления финансовыми рисками предприятия
	1.5. Методический инструментарий управления финансовыми рисками предприятия
2. Практический инструментарий риск-менеджмента	2.1. Исследование систематических финансовых рисков предприятия
	2.2. Исследование несистематических финансовых рисков предприятия
	2.3. Управление операционными рисками
	2.4. Управление проектными рисками предприятия
	2.5. Управление рисками финансовых инвестиций предприятия
3. Механизмы нейтрализации рисков	3.1. Основные механизмы нейтрализации финансовых рисков предприятия
	3.2. Механизмы хеджирования финансовых рисков с помощью фьючерсных и форвардных контрактов
	3.3. Механизмы хеджирования финансовых рисков с помощью опционных и своп контрактов
	3.4. Механизмы хеджирования финансовых рисков с помощью опционных и своп контрактов

Общая трудоемкость дисциплины (учебного курса) – 5 ЗЕТ.

4. Содержание и структура дисциплины Б.1.В.09«Риск-менеджмент» (наименование дисциплины (учебного курса))

Курс изучения 4

Раздел, модуль	Подраздел, тема	Виды учебной работы							Необходимые материально- технические ресурсы	Формы текущего контроля (наименова ние оценочного средства)	Рекомендуе мая литература (№)
		Контактная работа (в часах)					Самостоятельная работа				
		всего			в т.ч. в интерактивной форме	Формы проведения лекций, лабораторных, практических занятий, методы обучения, реализующие применяемую образовательную технологию	в часах	формы организации самостоятельной работы			
		лекций	лабораторных	практических							
Модуль 1. Теоретические основы риск- менеджмент	1.1. Экономическая сущность финансового риска и его классификации					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	8	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS- системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС- рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самконтр оля	1,2
	1.1. Экономическая сущность финансового риска и его классификации			2		Выполнение практических заданий с консультацией преподавателя на форуме и через комментарии в заданиях	4	Самостоятельное выполнение практических заданий, контроль смены текущей успеваемости при помощи БРС- рейтинга IP- адресов, анализ	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Задание 1	1,2
	1.2. Сущность и					Аудио-/видео- лекции	8	Самостоятельное	LMS-система на	Тест для	1,2

	содержание риск – менеджмента. Профессия риск-менеджера					электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме		изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	самоконтроля Промежуточный тест	
	1.3. Сущность, цель и функции управления финансовыми рисками предприятия					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	8	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля	1,2
	1.4. Системы обеспечения управления финансовыми рисками предприятия					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля	1,2

								лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга			
	1.4. Системы обеспечения управления финансовыми рисками предприятия			2		Выполнение практических заданий с консультацией преподавателя на форуме и через комментарии в заданиях	4	Самостоятельное выполнение практических заданий, контроль смены текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга IP-адресов, анализ	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Задание 2	1,2
	1.5. Методический инструментарий управления финансовыми рисками предприятия					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконт роля	1,2

	1.5. Методический инструментарий управления финансовыми рисками предприятия	2				Вебинар на онлайн-площадке, дискуссия в чате вебинара	4	Изучение видеолекции по итогам вебинара, тесты для самоконтроля	Компьютер либо планшет либо смартфон		1,2
Модуль 2. Практический инструментарий риск-менеджмента	2.1. Исследование систематических финансовых рисков предприятия					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультациями преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля	1,2
	2.2. Исследование несистематических финансовых рисков предприятия					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультациями преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля	1,2

							помощи БРС-рейтинга				
	2.3. Управление операционными рисками					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля	1,2
	2.4. Управление проектными рисками предприятия					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля	1,2
	2.4. Управление проектными рисками			2		Выполнение практических заданий с консультацией преподавателя на форуме	7	Самостоятельное выполнение практических	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо	Задание 3	1,2

	предприятия					и через комментарии в заданиях		заданий, контроль смены текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга IP-адресов, анализ	планшет либо смартфон		
	2.5. Управление рисками финансовых инвестиций предприятия					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультациями преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля Промежуточный тест	1,2
Модуль 3. Механизмы нейтрализации рисков	3.1. Основные механизмы нейтрализации финансовых рисков предприятия					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультациями преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля	1,2

							рейтинга			
3.2. Механизмы хеджирования финансовых рисков с помощью фьючерсных и форвардных контрактов					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультациями преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля	1,2
3.3. Механизмы хеджирования финансовых рисков с помощью опционных и своп контрактов					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультациями преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконтроля	1,2
3.3. Механизмы хеджирования финансовых рисков с			2		Выполнение практических заданий с консультацией преподавателя на форуме и через комментарии в	4	Самостоятельное выполнение практических заданий, контроль	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо	Задание 4	1,2

	помощью опционных и своп контрактов					заданиях		смены текущей успеваемости при помощи БРС- рейтинга IP- адресов, анализ	смартфон		
	3.4. Механизмы хеджирования финансовых рисков с помощью опционных и своп контрактов					Аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме	10	Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга	LMS-система на основе Moodle, компьютер либо планшет либо смартфон	Тест для самоконт роля	1,2
	3.4. Механизмы хеджирования финансовых рисков с помощью опционных и своп контрактов	2				Вебинар на онлайн- площадке, дискуссия в чате вебинара	4	Изучение видеолекции по итогам вебинара, тесты для самоконтроля	Компьютер либо планшет либо смартфон	Промежу точный тест	1,2
Контроль							8,65	Самостоятельное тестирование по банку тестовых заданий не менее 600 вопросов, анализ поведения тестирующихся при помощи LRS- системы и Experience API, контроль смены IP- адресов, удаленная аутентификация при помощи распознавания лиц,	LMS-система на основе Moodle, ком- пьютер либо планшет ли-бо смартфон	Итоговый тест	1,2

							анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга			
Итого:	10,35					161				
	180									

5. Количество баллов, критерии и нормы текущего контроля и промежуточной аттестации

Формы текущего контроля	Условия допуска	Критерии и нормы оценки
Задание 1	Отсутствуют	4 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла - задание выполнено не в полном объеме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объеме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 2	Отсутствуют	4 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла - задание выполнено не в полном объеме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объеме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 3	Отсутствуют	4 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла - задание выполнено не в полном объеме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объеме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 4	Отсутствуют	5 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объеме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла - задание выполнено не в полном объеме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объеме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено

Заполненная анкета	Отсутствуют	3 балла – анкета заполнена 0 – анкета не заполнена
Итоговое тестирование	Отсутствуют	Максимальное количество баллов - 40 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Итого		Максимальное количество баллов – 100 б.

Форма проведения промежуточной аттестации	Условия допуска	Критерии и нормы оценки	
Экзамен (по накопительному рейтингу)	Выполнение всех учебных мероприятий	«отлично»	Студент набрал 80 и более баллов по накопительному рейтингу
		«хорошо»	Студент набрал от 60 до 79 баллов по накопительному рейтингу
		«удовлетворительно»	Студент набрал от 40 до 59 баллов по накопительному рейтингу
		«неудовлетворительно»	Студент набрал 39 и менее баллов по накопительному рейтингу

6. Критерии и нормы оценки курсовых работ (проектов)

Курсовые работы (проекты) учебным планом не предусмотрены.

7. Примерная тематика письменных работ (курсовых, рефератов, контрольных, расчетно-графических и др.)

Письменные работы (проекты) учебным планом не предусмотрены.

8. Вопросы к экзамену

8.1. Вопросы к экзамену

№ п/п	Вопросы
1.	Развитие теории риска в процессе эволюции экономической мысли.
2.	Характеристика риска как объекта финансового управления предприятием.
3.	Классификация финансовых рисков предприятия.
4.	Экономическая сущность управления финансовыми рисками предприятия.
5.	Цель и задачи управления финансовыми рисками предприятия.
6.	Функции управления финансовыми рисками предприятия.
7.	Механизм управления финансовыми рисками предприятия.
8.	Этапы процесса управления финансовыми рисками предприятия.
9.	Факторы, генерирующие финансовые риски предприятия.
10.	Сущность информационной системы финансового риск-менеджмента и ее пользователи.
11.	Требования, предъявляемые к финансовой информации при принятии рискованных решений.
12.	Система показателей информационного обеспечения риск-менеджмента, формируемых из внешних и внутренних источников.
13.	Сущность и формы риск-анализа финансовой деятельности предприятия.
14.	Основные системы риск-анализа (горизонтальный, вертикальный, сравнительный, интегральный, анализ коэффициентов).
15.	Сущность и основные задачи системы риск-планирования финансовой деятельности предприятия.
16.	Основные системы финансового риск-планирования (перспективное, текущее и оперативное).
17.	Сущность и функции системы риск-контроллинга финансовой деятельности предприятия.
18.	Принципы построения системы финансового риск-контроллинга.
19.	Основные этапы построения финансового риск-контроллинга на предприятии.
20.	Виды финансового риск-контроллинга (стратегический, текущий, оперативный).
21.	Методический инструментальный оценки стоимости денег по простым и сложным процентам.
22.	Методический инструментальный оценки стоимости денег при аннуитете.
23.	Методический инструментальный прогнозирования годового темпа и индекса инфляции.
24.	«Матрица решений» в процессе принятия решения в условиях риска и неопределенности.
25.	«Матрица полезности» в процессе принятия решения в условиях риска и неопределенности на основе «функции полезности Неймана-Монгерштерна».
26.	Критерий Вальда (критерий «максимина») принятия рискованных решений в условиях неопределенности.
27.	Критерий максимакса принятия рискованных решений в условиях неопределенности.
28.	Критерий Гурвица (критерий «оптимизма-пессимизма») принятия рискованных решений в условиях неопределенности.
29.	Критерий Сэвиджа (критерий потерь от «минимакса») принятия рискованных решений в условиях неопределенности.
30.	Внутренняя финансовая среда предприятия: сущность, факторы.
31.	Модель внутренней финансовой позиции предприятия (SWOT-анализ).

32.	Финансовая политика предприятия: сущность, типы.
33.	Финансовые инструменты с целью снижения и нейтрализации финансовых рисков предприятия.
34.	Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков.
35.	Хеджирование финансовых рисков предприятия.
36.	Диверсификация и самострахование финансовых рисков предприятия.
37.	Страхование финансовых рисков предприятия: сущность и принципы.
38.	Классификация страхования финансовых рисков предприятия.
39.	Оптимизация состава внеоборотных и оборотных активов предприятия как метод снижения риска финансовой неустойчивости предприятия.
40.	Оптимизация соотношения собственного и заемного капитала предприятия как метод снижения риска финансовой неустойчивости предприятия.
41.	Риск неплатежеспособности предприятия: сущность, этапы управления денежными потоками.
42.	Направления оптимизации денежных потоков: сбалансирование объемов денежных потоков.
43.	Направления оптимизации денежных потоков: синхронизация денежных потоков во времени.
44.	Направления оптимизации денежных потоков: максимизация чистого денежного потока.
45.	Управление текущей дебиторской задолженностью предприятия как метод снижения риска предприятия.
46.	Направления нейтрализации проектных рисков.
47.	Сущность и задачи антикризисного финансового управления предприятием.
48.	Этапы процесса антикризисного финансового управления предприятием.
49.	Этапы осуществления фундаментальной диагностики финансового кризиса предприятия.
50.	Внешние факторы, обуславливающие кризисное финансовое развитие предприятия.
51.	Внутренние факторы, обуславливающие кризисное финансовое развитие предприятия.
52.	Основные этапы финансовой стабилизации предприятия.
53.	Временная оптимизация инвестиционных проектов
54.	Пространственная оптимизация инвестиционных проектов
55.	Модель САРМ
56.	Теорема разграничения Фишера
57.	Модель Баумоля
58.	Модель Миллера-Ора
59.	Показатели эффективности управления дебиторской задолженностью
60.	Политика управления дебиторской задолженностью. Формирование резерва по сомнительным долгам

8.2. Вопросы к зачету

По учебному курсу данный подраздел не предусмотрен

9. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

9.1. Паспорт фонда оценочных средств

№ п/п	Контролируемые разделы (темы) дисциплины	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
1	Модуль 1. Теоретические основы риск-менеджмент	ОПК-3, ОПК-4, ПК-2	Тесты для самоконтроля Задание 1 Задание 2 Промежуточный тест 1
2	Модуль 2. Практический инструментарий риск-менеджмента		Тесты для самоконтроля Задание 3 Промежуточный тест 2
3	Модуль 3. Механизмы нейтрализации рисков		Тесты для самоконтроля Задание 4 Промежуточный тест 1
4	Экзамен		Итоговый тест

9.2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

9.2.1. Задания, проверяемые вручную

Задание 1

Раскройте содержание каждого из классификационных признаков финансовых рисков, представленных в таблице.

№ п/п	Вид финансового риска	Содержание финансового риска
1	Валютный риск	
2	Ценовой риск	
3	Риск снижения финансовой устойчивости компании	
4	Кредитный риск	
5	Инвестиционный риск	
6	Депозитный риск	
7	Инновационный риск	

Задание 2

Раскройте содержание каждой из систем обеспечения управления финансовыми рисками предприятия, представленных в таблице.

№ п/п	Вид системы обеспечения управления финансовыми рисками	Характеристика системы обеспечения управления финансовыми рисками
1	Риск-анализ	

2	Риск-контроллинг	
3	Риск-планирование	
4	Система информационного обеспечения	

Задание 3

Эксперты оценивают ожидаемый доход от реализации альтернативных инвестиционных проектов с помощью показателей, приведённых в таблице.

Ситуация	Проект 1		Проект 2	
	Ожидаемый доход, тыс. \$ (A_i)	Вероятность его получения (P_i)	Ожидаемый доход, тыс. \$ (A_i)	Вероятность его получения (P_i)
Оптимистическая	700	0,35	900	0,20
Наиболее вероятная	500	0,45	550	0,55
Пессимистическая	400	0,20	250	0,25

Сравните эти проекты по уровню риска и ожидаемого дохода, порекомендуйте один из проектов на основе соотношения уровня риска и ожидаемого дохода.

Задание 4

Компания имеет крупный кредит в валюте, по которому необходимо внести последний платёж через три месяца. Ввиду нестабильной ситуации в экономике компания остерегается роста курса валюты и желает зафиксировать курс валюты уже сегодня. Опишите механизм хеджирования и механизм формирования финансового результата хеджера, если в качестве инструмента хеджирования выбран фьючерсный контракт.

Критерии оценки:

Формы текущего контроля	Критерии и нормы оценки
Задание 1	4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 2	4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 3	4 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 4	5 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 3 балла – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 2 балла – задание выполнено не в полном объёме, есть незначительные замечания 1 балла – задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено

9.2.2. Примерный перечень тестовых заданий (для вопросов для самоконтроля в электронном учебнике; для проведения промежуточного тестирования, для проведения итогового тестирования)

Модуль 1. Теоретические основы риск-менеджмент

Задание №1

Группа рисков, генерирующая различные финансовые угрозы в финансовой деятельности, –		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		группа товарных рисков
2)		группа финансовых рисков
3)		группа валютных рисков
4)		группа предпринимательских рисков

Задание №2		
Главная задача финансового риск-менеджмента состоит		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		в обеспечении финансовой устойчивости в долгосрочном периоде
2)		в максимизации прибыли предприятия
3)		в обеспечении сбалансированности поступления денежных средств
4)		в выявлении экономической сущности и установлении видов воздействия финансовых рисков на результаты хозяйственной деятельности

Задание №3		
Гомер (древнегреческий поэт) определял термин «риск» как		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		«вулкан»
2)		«опасность лавирования между скал»
3)		«утес»
4)		«течение реки»

Задание №4		
В какой стране появились первые договоры о компенсации убытков, связанных с риском гибели?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		В Афинах
2)		В Греции
3)		В Аргосе
4)		В Финикии

Задание №5		
В каком древнем городе были заложены законодательные основы страхования рисков?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		В Армавире
2)		В Вавилоне
3)		В Перле
4)		В Дибоне

Задание №6		
В каком году были созданы законы Хаммурапи?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		

1)		В 1750-х гг. до н. э.
2)		В 1760-х гг. н. э.
3)		В 1800-х гг. до н. э.
4)		В 1740-х гг. н. э.

Задание №7

Какой из экономических ученых написал книгу «Исследование о природе и причинах богатства народов»?

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		А. Смитт
2)		К. Маркс
3)		Д. Рикардо
4)		Й. Шумпетер

Задание №8

Какая теория легла в основу экономической парадигмы предпринимательского риска?

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		Теория предельной полезности
2)		Теория «больших волн»
3)		Теория общественного выбора
4)		Теория социально ориентируемого рыночного хозяйства

Задание №9

Укажите гипотезу, выдвинутую Д. Бернулли в статье о Санкт-Петербургском парадоксе.

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		Экономическое ожидание выигрыша определяется с учетом его объективной оценки
2)		Психологическое ожидание выигрыша определяется с учетом его объективной оценки
3)		Математическое ожидание выигрыша определяется с учетом его субъективной оценки
4)		Ожидание выигрыша определяется с учетом его субъективной оценки

Задание №10

Французский ученый Морис Алле является автором работы _____, посвященной риск-менеджменту.

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		«Экономика предложения»
2)		«Новая экономическая история»
3)		«Поведение рационального человека в условиях риска»
4)		«Теория агентов»

Задание №11

Какой из школ экономического учения была углублена теория получения сверхприбыли в

процессе осуществления рисковей деятельности?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Марксистской школой
2)		Кейнсианской школой
3)		Маржиналистской школой
4)		Капиталистической школой

Задание №12		
Согласно теории К. Маркса, одним из двух главных источников сверхприбыли капиталистов является		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		создание большего количества продукции
2)		сохранение старых технологий
3)		внедрение нового оборудования
4)		наем квалифицированного персонала

Задание №13		
Какая из экономических школ наибольшее внимание уделяла проблемам риска?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Классическая школа
2)		Школа Фишера
3)		Неоклассическая школа
4)		Русская экономическая школа

Задание №14		
Какая модель А. Маршалла лежит в основе модели экономического поведения предпринимателей в условиях риска?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Модель ликвидации риска
2)		Модель неприятия риска
3)		Модель отторжения риска
4)		Модель распределения риска

Задание №15		
Кто из экономистов написал книгу «Теория экономического развития» в 1912 г.?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		К. Маркс
2)		Д. Рикардо
3)		Й. Шумпетер
4)		А. Маршалл

Задание №16		
Категории «априорная вероятность» и «статистическая вероятность», по мнению экономиста Ф. Найта, – это		

Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		функции риска
2)		признаки риска
3)		условия риска
4)		виды риска

Задание №17		
Условия неопределенности, по мнению экономиста Ф. Найта, – это условия, в которых		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		известны вероятность и возможные результаты
2)		известна вероятность, но неизвестны возможные результаты
3)		полный набор возможных результатов и вероятности неизвестны
4)		неизвестна вероятность, но известны возможные результаты

Задание №18		
Кто из экономических деятелей написал книгу «Риск, неопределенность и прибыль» в 1921 г.?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Й. Шумпетер
2)		Й. Тюнен
3)		Ф. Найт
4)		А. Маршалл

Задание №19		
Какую из перечисленных ниже работ написал Дж. Кейнс?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		«Основания национальной экономики»
2)		«Курс политической экономики»
3)		«Общая теория полезности»
4)		«Общая теория занятости»

Задание №20		
Какая из представленных ниже теорий получила наиболее широкое использование в практике финансового риск-менеджмента?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		«Современная портфельная теория»
2)		«Модель оценки стоимости опционов»
3)		«Общая теория полезности»
4)		«Общая теория занятости»

Модуль 2. Практический инструментальный риск-менеджмента

Задание №1		
Проектный риск, при котором эффективность проекта отрицательна, то есть сумма чистого денежного потока меньше суммы инвестиционных затрат, называется		

Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		катастрофическим
2)		критическим
3)		допустимым
4)		внешним

Задание №2		
Целью количественного анализа проектных рисков выступает		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		выявление рисков
2)		описание рисков
3)		группировка рисков
4)		измерение рисков

Задание №3		
Относительным показателем риска инвестиционного проекта является		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		дисперсия
2)		коэффициент вариации
3)		среднее ожидаемое значение
4)		среднеквадратическое отклонение

Задание №4		
Укажите показатель риска, который характеризует, на сколько в среднем в абсолютном выражении каждый возможный вариант реализации инвестиционного проекта отклоняется от средней величины.		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Среднеквадратическое отклонение
2)		Коэффициент вариации
3)		Дисперсия
4)		Среднее ожидаемое значение

Задание №5		
Какой из показателей характеризует риск на единицу ожидаемого результата?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Дисперсия
2)		Стандартное отклонение
3)		Коэффициент вариации
4)		Среднее ожидаемое значение

Задание №6		
Какой показатель используют для сравнения рисков проектов с различными значениями среднего ожидаемого дохода?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		

1)		Среднеквадратическое отклонение
2)		Коэффициент вариации
3)		Индекс рентабельности
4)		Дисперсия

Задание №7

Средневзвешенное значение всех возможных результатов реализации проекта – это

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		среднеквадратическое отклонение
2)		коэффициент вариации
3)		дисперсия
4)		среднее ожидаемое значение

Задание №8

В каком диапазоне следует ожидать колебания доходности инвестиционного проекта с вероятностью 68,27 %?

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		Аср _{едн.} $\pm 1,29\sigma$
2)		Аср _{едн.} $\pm \sigma$
3)		Аср _{едн.} $\pm 3\sigma$
4)		Аср _{едн.} $\pm 2\sigma$

Задание №9

В каком диапазоне следует ожидать колебания доходности инвестиционного проекта с вероятностью 99,73 %?

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		Аср _{едн.} $\pm 1,29\sigma$
2)		Аср _{едн.} $\pm \sigma$
3)		Аср _{едн.} $\pm 3\sigma$
4)		Аср _{едн.} $\pm 2\sigma$

Задание №10

Коэффициент вариации рассчитывается по формуле

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		среднее ожидаемое значение / дисперсия
2)		дисперсия / среднее ожидаемое значение
3)		среднее ожидаемое значение / стандартное отклонение
4)		стандартное отклонение / среднее ожидаемое значение

Задание №11

Цель _____ – оценить, насколько сильно изменится эффективность проекта при определённом изменении одного из параметров проекта.

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		анализа вероятностей
----	--	----------------------

2)		метода предпочтительного состояния
3)		имитационной модели
4)		анализа чувствительности

Задание №12

Основной целью какого вида анализа является оценка суммы и уровня среднего остатка денежных активов с позиции обеспечения платежеспособности предприятия?

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		Анализа собственных средств
2)		Анализа денежных активов предприятия в предшествующем периоде
3)		Анализа совокупного капитала предприятия
4)		Анализа пассивов предприятия

Задание №13

Для расчета коэффициента участия денежных активов в совокупных оборотных активах используют

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		произведение среднего совокупного остатка денежных активов предприятия за рассматриваемый период и средней суммы оборотных активов
2)		отношение суммы оборотных активов к сумме внеоборотных активов
3)		отношение среднего совокупного остатка денежных активов предприятия за рассматриваемый период к средней сумме оборотных активов
4)		произведение оборотных активов и суммы внеоборотных активов

Задание №14

Обратным показателем среднего периода оборота денежных активов является

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		средний остаток совокупных денежных активов
2)		коэффициент рентабельности краткосрочных финансовых инвестиций
3)		количество оборотов среднего остатка денежных активов
4)		коэффициент вариации поступления денежных средств

Задание №15

В какой модели исходные положения предусматривают наличие определенного размера страхового запаса и определенную неравномерность в поступлении и расходовании денежных средств, а соответственно и остатка денежных активов?

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		Модель Миллера – Орра
2)		Модель Баумоля
3)		Модель Тобина
4)		Модель Марковица

Задание №16

В какой модели исходными положениями является постоянство потока расходования денежных средств, хранение всех резервов денежных активов в форме краткосрочных финансовых

инвестиций и изменение остатка денежных активов от их максимума и минимума, равного нулю?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Модель Миллера – Орра
2)		Модель Баумоля
3)		Модель Тобина
4)		Модель Марковица

Задание №17

Выберите верное суждение.

Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Хроническая нехватка оборотных активов позволяет предприятиям формировать остаток денежных средств в необходимых размерах с учетом их резерва
2)		Замедление платежного оборота не вызывает колебаний в размерах денежных поступлений
3)		Хроническая нехватка оборотных активов не позволяет предприятиям формировать остаток денежных средств в необходимых размерах с учетом их резерва; замедление платежного оборота вызывает значительные колебания в размерах денежных поступлений, что соответственно отражается и на сумме остатка денежных активов
4)		Ускорение платежного оборота вызывает значительные колебания в размерах денежных поступлений, что соответственно отражается и на сумме остатка денежных активов

Задание №18

Определение потребности в страховом остатке денежных активов осуществляется

Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		исходя из финансовых возможностей предприятия только после того, как полностью обеспечена потребность в других видах остатков денежных активов
2)		на основе рассчитанной суммы их операционного остатка и коэффициента неравномерности поступления денежных средств
3)		в размере, который определен соглашением о банковском обслуживании
4)		на основе рассчитанной суммы их операционного остатка и коэффициента ликвидности

Задание №19

Что не относится к основным направлениям оптимизации денежного потока?

Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Максимизация чистого денежного потока
2)		Синхронизация денежных потоков во времени
3)		Минимизация чистого денежного потока
4)		Сбалансирование объемов денежных потоков

Задание №20

Отрицательные последствия дефицитного денежного потока проявляются

Выберите несколько из 4 вариантов ответа:		
1)		в росте просроченной кредиторской задолженности

2)		в потере реальной стоимости временно неиспользуемых денежных средств от инфляции
3)		в потере потенциального дохода от неиспользуемой части денежных активов в сфере краткосрочного их инвестирования
4)		в снижении ликвидности и уровня платежеспособности

Модуль 3. Механизмы нейтрализация рисков

Задание №1

Инвестор купил европейский трехмесячный опцион пут на акцию с ценой исполнения 100 руб. за 5 руб. К моменту окончания контракта спотовая цена акции составила 98 руб. Определите финансовый результат операции для инвестора.

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		5 руб.
2)		–5 руб.
3)		3 руб.
4)		–3 руб.

Задание №2

Чему равна максимальная прибыль продавца опциона колл с ценой исполнения 120 руб. и премией 7 руб.?

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		7 руб.
2)		113 руб.
3)		127 руб.
4)		120 руб.

Задание №3

Спот-цена базового актива составляет 120 д. е. Выберите опционы в деньгах.

Выберите несколько из 4 вариантов ответа:

1)		Опцион колл со страйком 125
2)		Опцион пут со страйком 125
3)		Опцион колл со страйком 115
4)		Опцион пут со страйком 115

Задание №4

Мукомольная фабрика планирует через полгода закупить зерно, однако опасается роста цены на данный актив. Что может сделать компания, чтобы захеджировать риск роста цены?

Выберите несколько из 4 вариантов ответа:

1)		Купить на бирже определённое количество опционных контрактов колл на зерно
2)		Продать на бирже определённое количество опционных контрактов колл на зерно
3)		Купить на бирже определённое количество опционных контрактов пут на зерно
4)		Продать на бирже определённое количество опционных контрактов пут на зерно

Задание №5

В валютном свопе происходит обмен

Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		долгового обязательства с фиксированной процентной ставкой на обязательство с плавающей ставкой
2)		номинала и фиксированных процентов в одной валюте на номинал и фиксированный процент в другой валюте
3)		фиксированных платежей на плавающие платежи, величина которых привязана к цене определенного товара
4)		потоков наличности, основанных на суммарной доходности какого-либо фондового индекса или процентной ставки

Задание №6		
Что такое опцион «в деньгах»?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		По базисному активу начислен доход (дивиденды, проценты)
2)		Существует возможность получения прибыли от альтернативного вложения
3)		Опцион имеет внутреннюю стоимость
4)		Премия по опциону превышает его внутреннюю стоимость

Задание №7		
Премия по опциону – это		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		сумма, выплачиваемая покупателем опциона при его покупке
2)		выигрыш, получаемый покупателем опциона в случае его исполнения
3)		выигрыш, получаемый покупателем опциона в случае его неисполнения
4)		разность между спот-ценой базисного актива и ценой заключенного контракта

Задание №8		
Внутренняя стоимость опциона колл определяется как		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		цена-спот – цена-страйк
2)		цена-страйк – цена-спот
3)		цена-спот + цена-страйк
4)		цена-страйк + цена-спот

Задание №9		
Максимальная прибыль продавца опциона – это		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		премия
2)		внутренняя стоимость
3)		временная стоимость
4)		цена-страйк

Задание №10		
Временная стоимость опциона на дату экспирации равна		

Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		цене-спот
2)		цене-страйк
3)		премии
4)		нулю

Задание №11		
Цена опциона – это		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		премия по опциону
2)		цена-страйк
3)		внутренняя стоимость
4)		спот-цена

Задание №12		
Цена исполнения опциона – это		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		премия по опциону
2)		цена-страйк
3)		внутренняя стоимость
4)		спот-цена

Задание №13		
Какой опцион можно исполнить только в день истечения срока действия опционного контракта?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Американский
2)		Европейский
3)		Колл
4)		Пут

Задание №14		
При каком условии опцион пут имеет внутреннюю стоимость?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Цена страйк > Цена спот
2)		Цена страйк < Цена спот
3)		Цена страйк = Цена спот
4)		Временная стоимость = 0

Задание №15		
Премия по опциону состоит		
Выберите несколько из 4 вариантов ответа:		
1)		из цены спот
2)		из цены страйк

3)		из внутренней стоимости
4)		из временной стоимости

Задание №16

Рассчитайте внутреннюю стоимость для опциона пут на акцию с ценой исполнения 270 руб., если текущая цена акции 250 руб.

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		– 20
2)		0
3)		20
4)		10

Задание №17

Рассчитайте внутреннюю стоимость для опциона пут на акцию с ценой исполнения 120 руб., если текущая цена акции 100 руб.

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		0
2)		20
3)		80
4)		220

Задание №18

Рассчитайте внутреннюю стоимость для опциона колл на акцию с ценой исполнения 100 руб., если текущая цена акции 120 руб.

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		0
2)		20
3)		80
4)		220

Задание №19

Фермер планирует через полгода продать зерно, однако опасается снижения цены на данный актив. Что может сделать фермер, чтобы захеджировать риск снижения цены?

Выберите несколько из 4 вариантов ответа:

1)		Купить на бирже определённое количество опционных контрактов колл на зерно
2)		Продать на бирже определённое количество опционных контрактов колл на зерно
3)		Купить на бирже определённое количество опционных контрактов пут на зерно
4)		Продать на бирже определённое количество опционных контрактов пут на зерно

Задание №20

Компания планирует расплатиться по валютному кредиту через полгода, однако опасается значительного роста курса валюты. Сегодня курс валюты составляет 60 руб. Компания купила сегодня определённое количество опционных контрактов колл на страйке 62 за 3 руб. Какой курс валюты захеджировала компания, если через полгода курс валюты вырос до 70 руб.?

Выберите один из 4 вариантов ответа:

1)		59 руб.
2)		60 руб.
3)		65 руб.
4)		70 руб.

Промежуточный тест
Промежуточный тест

Задание №1		
Пределы финансового риска со средним уровнем вероятности реализации –		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		от 0 до 5%
2)		от 10 до 25 %
3)		от 5 до 25 %
4)		от 25 до 50 %

Задание №2		
По уровню возможных финансовых потерь риски делятся		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		на допустимый и критический
2)		на критический и катастрофический
3)		на допустимый и катастрофический
4)		на допустимый, критический и катастрофический

Задание №3		
По возможности предвидения финансовые риски делятся		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		на страхуемый и нестрахуемый
2)		на прогнозируемый и непрогнозируемый
3)		на временный и постоянный
4)		на индивидуальный и портфельный

Задание №4		
Такая характеристика риска, как альтернативность выбора, означает, что		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		финансовый риск предполагает потребность выбора альтернативы действий финансового менеджера
2)		действие осуществляется финансовым менеджером в условиях ситуации неопределенности или рискованной ситуации при наличии вариантов этого выбора
3)		риск сопровождает практически все виды финансовых операций и все направления финансовой деятельности компании
4)		финансовый риск проявляется в сфере экономической деятельности компании

Задание №5		
-------------------	--	--

Какой из видов риска связан с понесением финансовых потерь из-за неблагоприятных изменений ценовых индексов на активы, которые обращаются на финансовом рынке?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Ценовой риск
2)		Валютный риск
3)		Кредитный риск
4)		Депозитный риск

Задание №6		
Коммерческий риск – это риск, возникающий		
Выберите несколько из 4 вариантов ответа:		
1)		на коммерческих предприятиях
2)		при заключении коммерческих сделок
3)		в процессе реализации товаров или услуг
4)		в процессе производства товаров или услуг

Задание №7		
Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска
2)		прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска
3)		умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности
4)		разработку и осуществление мер, при помощи которых могут быть нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные результаты предпринимаемых действий

Задание №8		
Суть риск-менеджмента состоит		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		в устранении риска
2)		в управлении риском
3)		в снижении риска
4)		в выборе риска

Задание №9		
Какая из представленных ниже систем риск-контроллинга носит название «первичная информационная база наблюдения»?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Система показателей форм контрольных отчетов
2)		Система информативных отчетных показателей по каждому виду финансового риск-контроллинга
3)		Система алгоритмов действий по устранению отклонений

4)	Система мониторинга
----	---------------------

Задание №10

Многофакторная оценка условий формирования отдельных агрегированных финансовых показателей в условиях проявления факторов риска – это _____ финансовый анализ.

Запишите ответ:

1)	Ответ:
----	--------

Критерии оценки:

Формы текущего контроля	Критерии и нормы оценки	
Промежуточный тест 1	Максимальное количество баллов - 4 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)	
Промежуточный тест 2	Максимальное количество баллов - 4 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)	
Промежуточный тест 3	Максимальное количество баллов - 5 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)	
Тест для самоконтроля по лекции 1.1	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 1.2	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 1.3	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 1.4	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 1.5	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 2.1	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 2.2	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 2.3	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 2.4	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 3.1	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 3.2	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 3.3	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Тест для самоконтроля по лекции 3.4	Максимальное количество баллов - 2 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально правильным ответам)	
Итоговое тестирование	Максимальное количество баллов - 40 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)	
Итого		Максимальное количество баллов – 100 б.

10. Образовательные технологии и методические указания по освоению дисциплины

С целью формирования компетенций у студентов в учебном процессе используются аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме.

В процессе изучения дисциплины используется дистанционного обучения.

При подготовке к ответам на тесты по темам курса и выполнению типовых заданий студенту необходимо тщательно изучить предлагаемую литературу, нормативные правовые акты, учебный материал.

Студент самостоятельно работает с дополнительной и основной литературой, нормативными актами, интернет-ресурсами.

При необходимости задать вопросы преподавателю в форуме.

После изучения курса выполнить итоговый тест.

Разместить на личной странице курса выполненные задания практикума для проверки преподавателем.

11. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

11.1. Обязательная литература

№ п/ п	Библиографическое описание	Тип (учебник, учебное пособие, учебно- методическое пособие, практикум, др.)	Количество в библиотеке
1.	Фирсова О. А. Управление рисками организаций [Электронный ресурс] : учеб.-метод. пособие / О. А. Фирсова ; Межрегиональная Академия безопасности и выживания (МАБИБ). - Орел : МАБИБ, 2014. - 82 с.	Учебно-методическое пособие	ЭБС "IPRbooks"
2.	Шапкин А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций [Электронный ресурс] : учебник / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 6-е изд. - Москва : Дашков и К°, 2014. - 880 с. - (Учебные издания для бакалавров). - ISBN 978-5-394-02170-1.	Учебник	ЭБС "IPRbooks"

СОГЛАСОВАНО

Директор научной библиотеки

(подпись)

А.М. Асаева

(И.О. Фамилия)

«__»__20__г.
МП

11.2. Дополнительная литература и учебные материалы (аудио-, видеопособия и др.)

- фонд научной библиотеки ТГУ:

№ п/п	Библиографическое описание	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, аудио-, видеопособия и др.)	Количество в библиотеке
1	Тактаров Г. А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски : учеб. пособие для студентов, обуч. по специальностям "Бухгалтер. учет, анализ и аудит", "Финансы и кредит", "Налоги и налогообложение" / Г. А. Тактаров, Е. М. Григорьева. - 2-е изд., перераб. и доп. ; гриф УМО. - Москва : Кнорус, 2015. - 255 с. : ил. - (Бакалавриат). - Библиогр.: с. 254-255. - ISBN 978-5-406-04244-1	учеб. пособие	1

- другие фонды:

№ п/п	Библиографическое описание	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, аудио-, видеопособия и др.)	Место хранения (методический кабинет кафедры, городские библиотеки и др.)
1	Риск-менеджмент: электронный контент – Тольятти: Изд-во ТГУ. – образовательная среда Росдистант	Электронное издание	Образовательная среда Росдистант

11.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

- www.law.edu.ru - федеральный правовой портал Юридическая Россия;
- www.duma.gov.ru - официальный сайт Государственной Думы Российской Федерации;
- www.consultant.ru/ - официальный сайт компании «Консультант Плюс»;
- www.nalog.ru/ - официальный сайт Федеральной налоговой службы;
- www.minfin.ru/ru/ - официальный сайт Министерства финансов РФ;
- wiki.klerk.ru/ - бухгалтерская энциклопедия;
- ru.wikipedia.org/ - Википедия.

11.4. Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование ПО	Количество лицензий	Реквизиты договора (дата, номер, срок действия)
1	Windows	1398	Договор № 690 от 19.05.2015г., срок действия - бессрочно
2	Office Standart	1398	Договор № 690 от 19.05.2015г., срок действия - бессрочно; Договор № 727 от 20.07.2016г., срок действия - бессрочно
3	Консультант +	Неограниченно	Договор № 1522 от 25.12.2015г., срок действия - бессрочно

11.5. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий	Перечень основного оборудования	Фактический адрес учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др.	Площадь, м ²	Количество посадочных мест
1	Аудитория вебконференций. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа. Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации (УЛК-807).	Экран телевизионный, ширмы, проектор на штативе. стол преподавательский, стулья преподавательские, Транспарант-перетяжка, системный блок.	445020, Самарская обл., г. Тольятти, ул. Белорусская, д. 16 В	17,1	1

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий	Перечень основного оборудования	Фактический адрес учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др.	Площадь, м²	Количество посадочных мест
2	Аудитория вебконференций. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа. Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации (УЛК-810).	Экран телевизионный, ширма, прожектор на штативе. стол преподавательский, стул преподавательский, транспарант-перетяжка, системный блок.	445020, Самарская обл., г. Тольятти, ул. Белорусская, д. 16 В	17,9	1
3	Помещение для самостоятельной работы. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа. Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций. Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации (Г-401).	Стол учебные, стулья учебные, ПК с выходом в сеть Интернет	445020, Самарская обл., г. Тольятти, ул. Белорусская, д. 14	84,8	16