

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
СТАВРОПОЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**

УТВЕРЖДАЮ

Директор/Декан
института экономики, финансов и
управления в АПК
Гунько Юлия Александровна

«__» _____ 20__ г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ (ОЦЕНОЧНЫХ МАТЕРИАЛОВ)

Б1.В.03 Анализ и управление рисками

38.04.01 Экономика

Корпоративная финансовая аналитика

магистр

заочная

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций ОП ВО и овладение следующими результатами обучения по дисциплине:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине
ПК-2 Способен применять различные инструменты построения целевого инвестиционного портфеля	ПК-2.2 Выявляет качественные и количественные свойства рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах и аналитически обосновывает перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском	знает Выявление качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах.
		умеет Выявлять качественные и количественные свойства рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах.
		владеет навыками Навыков выявления качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах.
ПК-2 Способен применять различные инструменты построения целевого инвестиционного портфеля	ПК-2.3 Анализирует финансовые рынки, подбирает классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностям и клиента	знает Согласование условий инвестиционного портфеля с клиентом
		умеет Согласовывать условия инвестиционного портфеля с клиентом.
		владеет навыками Навыков согласования условий инвестиционного портфеля с клиентом.
ПК-4 Способен применять аналитические методики при разработке стратегии изменений организации	ПК-4.1 Определяет параметры будущего состояния	знает Определение параметров будущего состояния организации.
		умеет Определять параметров будущего состояния организации

	организации, выявляет, анализирует, классифицирует риски и разрабатывает комплекс мероприятий по их минимизации	владеет навыками Навыков определение параметров будущего состояния организации.
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------

2. Перечень оценочных средств по дисциплине

№	Наименование раздела/темы	Курс	Код индикаторов достижения компетенций	Оценочное средство проверки результатов достижения индикаторов компетенций
1.	1 раздел. Риск и методы его оценки			
1.1.	Риск как экономическая категория, его сущность	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	
1.2.	Методы оценки экономических рисков	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	
2.	2 раздел. Принятие решений в условиях неопределенности			
2.1.	Количественные оценки экономического риска в условиях неопределенности	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	
2.2.	Контрольная точка №1	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	Контрольная работа
2.3.	Статистические методы принятия решений в условиях риска	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	
3.	3 раздел. Дифференциация рисков в отраслях экономики			
3.1.	Инвестиционные риски	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	
3.2.	Оценка риска на основе анализа безубыточности предприятия	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	
3.3.	Контрольная точка №2	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	Контрольная работа
3.4.	Кредитные риски	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	
3.5.	Контрольная точка №3	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	Контрольная работа
3.6.	Промежуточная аттестация	2	ПК-2.2, ПК-2.3, ПК-4.1	
	Промежуточная аттестация			За

3. Оценочные средства (оценочные материалы)

Примерный перечень оценочных средств для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде (Оценочные материалы)
Текущий контроль			
Для оценки знаний			
Для оценки умений			
1	Контрольная работа	Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по теме или разделу	Комплект контрольных заданий по вариантам
Для оценки навыков			
Промежуточная аттестация			
2	Зачет	Средство контроля усвоения учебного материала практических и семинарских занятий, успешного прохождения практик и выполнения в процессе этих практик всех учебных поручений в соответствии с утвержденной программой с выставлением оценки в виде «зачтено», «незачтено».	Перечень вопросов к зачету

4. Примерный фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю) "Анализ и управление рисками"

Примерные оценочные материалы для текущего контроля успеваемости

Вопросы к экзамену

1. Сущность и определение риска.
2. Причины возникновения экономического риска.
3. Классификация рисков.
4. Характеристика основных этапов управления риском.
5. Методы оценки экономических рисков.
6. Принятие оптимальных решений в условиях неопределенности.
7. Матрица последствий и матрица рисков.
8. Анализ связанной группы решений в условиях полной неопределенности.
9. Правило Вальда.
10. Правило Сэвиджа.
11. Правило Гурвица.
12. Критерии принятия решений в условиях частичной неопределенности.
13. Оптимальность по Парето.
14. Правило Лапласа равновозможности.
15. Статистические методы принятия решений в условиях риска.
16. Измерители и показатели финансовых рисков.
17. Распределения вероятностей и ожидаемая доходность.
18. Комбинации ожидаемого значения и дисперсии как критерий риска.
19. Учет влияния асимметрии распределения вероятностей на риски.
20. Коэффициент вариации как критерий риска.
21. Оценка надежности инвестиций на основе анализа рисков.
22. Оценка риска, на основе анализа безубыточности предприятия.
23. Количественная оценка риска банкротства предприятия.
24. Факторы, способствующие возникновению кредитных рисков.
25. Анализ кредитных рисков.
26. Приемы уменьшения кредитных рисков.
27. Эффективная процентная ставка.
28. Нарращение и выплата процентов в потребительском кредите.
29. Кредитные гарантии.
30. Риск ликвидности.
31. Основные характеристики портфеля ценных бумаг.
32. Характеристика моделей портфеля ценных бумаг.
33. Модель Марковица о формировании портфеля заданной эффективности с учетом ведущего фактора.
34. Теория арбитражного ценообразования (АРТ).
35. Бета-коэффициент в модели ценных бумаг.
36. Характеристика рыночного (систематического) и собственного (несистематического) риска ценной бумаги.
37. Правило Парето, его использование при принятии финансовых решений.
38. Диверсификация портфеля.
39. Собственный риск портфеля. Рыночный риск портфеля.
40. Модель доходности финансовых активов (САРМ).
41. Линия рынка ценных бумаг (SML).
42. Линия рынка капитала (CML).
43. Модель Тобина-Шарпа-Литнера.
44. β -коэффициент портфеля ценных бумаг.
45. Портфель Марковица и Тобина максимальной эффективности.

***Примерные оценочные материалы
для проведения промежуточной аттестации (зачет, экзамен)
по итогам освоения дисциплины (модуля)***

Темы письменных работ (эссе, рефераты, курсовые работы и др.)

Темы рефератов

1. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.
2. Классификация рисков: виды, принципы, использование.
3. Прогнозирование, планирование и теория риска.
4. Принятие предпринимательских решений в условиях риска.
5. Факторы неопределенности в условиях рыночной экономики.
6. Виды рисков и способы их оценки.
7. Методы оценки эффективности управления рисками.
8. Методы оценки рисков предприятий.
9. Использование количественных методов анализа и оценки рисков.
10. Использование качественных методов анализа и оценки рисков.
11. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы.
12. Методы измерения рисков.
13. Модели оценки предпринимательских рисков.
14. Методы оценки рыночных и операционных рисков.
15. Использование специфических методов определения степени и меры риска.
16. Экспертные методы оценки рисков.
17. Организация и использование экспертных методов оценки риска.
18. Методы индивидуальной и групповой экспертных оценок: сходства и различия.
19. Подбор экспертов и формирование экспертных групп.
20. Принципы составления анкет для экспертного опроса.
21. Этапы процесса управления риском.
22. Учет рисков в бизнес-планировании.
23. Инновационные технологии в управлении рисками.
24. Роль субъективных факторов в управлении рисками.
25. Правовое обеспечение деятельности по управлению рисками в РФ.
26. Управление рисками в малом предпринимательстве.
27. Организация управления рисками на промышленном предприятии.
28. Организация управления рисками в финансово-кредитном учреждении.
29. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы.
30. Особенности управления рисками транснациональной корпорации.