ПРИЛОЖЕНИЕ А
ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ МАТЕРИАЛОВ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ
ПО ДИСЦИПЛИНЕ «Оценка рисков»

1. Перечень оценочных средств для компетенций, формируемых в результате освоения дисциплины

Код контролируемой компетенции	Способ оценивания	Оценочное средство
ПК-13: Способен анализировать риски, вероятность и объем экономических потерь; обобщать отечественную и зарубежную практику таможенно-тарифной политики и опыт проведения международных валютных, финансовых и кредитных операций	Зачет	Комплект контролирующих материалов для зачета
ПК-15: Способен осуществлять разработку проектных решений, разделов бизнес-планов организации	Зачет	Комплект контролирующих материалов для зачета

2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций, описание шкал оценивания

Оцениваемые компетенции представлены в разделе «Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций» рабочей программы дисциплины «Оценка рисков».

При оценивании сформированности компетенций по дисциплине «Оценка рисков» используется 100-балльная шкала.

Критерий	Оценка по 100-балльной шкале	Оценка по традиционной шкале
Студент освоил изучаемый материал, выполняет задания в соответствии с индикаторами достижения компетенций, может допускать отдельные ошибки.	25-100	*Зачтено*
Студент не освоил основное содержание изученного материала, задания в соответствии с индикаторами достижения компетенций не выполнены или выполнены неверно.	0-24	*Не зачтено*

3. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки уровня достижения компетенций в соответствии с индикаторами

1.Задание на оценку способности выполнять экономические расчеты бизнес-проектов

Компетенция	Индикатор достижения компетенции
ПК-15 Способен осуществлять разработку проектных решений, разделов бизнес-планов организации	ПК-15.2 Способен выполнять экономические расчеты бизнес-проектов

Какие виды рисков оказывают влияние на величину ставки дисконтирования?

2.Задание на оценку знаний методов анализа и оценки рисков и способности осуществлять оценку вероятности наступления рисковых ситуаций

Компетенция	Индикатор достижения компетенции
ПК-13 Способен анализировать риски, вероятность и объем экономических потерь; обобщать отечественную и зарубежную практику таможенно-тарифной политики и опыт проведения международных валютных, финансовых и кредитных операций	ПК-13.1 Демонстрирует знания методов анализа и оценки рисков
	ПК-13.2 Способен осуществлять оценку вероятности наступления рисковых ситуаций

Рассчитайте стандартное квадратическое отклонение, если стоимость акции в начале месяца была равна 70 руб., в середине месяца 130 руб, в конце месяца – 90 руб.

Насколько рискованным является приобретение такой акции?

3.Задание на оценку знаний методов анализа и оценки рисков и способности выполнять экономические расчеты бизнес-проектов

Компетенция	Индикатор достижения компетенции
ПК-13 Способен анализировать риски, вероятность и объем экономических потерь; обобщать отечественную и зарубежную практику таможенно-тарифной политики и опыт проведения международных валютных, финансовых и кредитных операций	ПК-13.1 Демонстрирует знания методов анализа и оценки рисков
ПК-15 Способен осуществлять разработку проектных решений, разделов бизнес-планов организации	ПК-15.2 Способен выполнять экономические расчеты бизнес-проектов

Среднемесячный доход организации составляет 600 тыс. руб. со стандартным отклонением 40 тыс. руб. Какова вероятность того, что доходность окажется:
-менее 550 тыс. руб;
-от 550 до 700 тыс. руб.
- минимальный доход дают 2% сделок. Какова их величина?

4.Задание на оценку знаний методов анализа и оценки рисков и способности осуществлять оценку вероятности наступления рисковых ситуаций

Компетенция	Индикатор достижения компетенции
ПК-13 Способен анализировать риски, вероятность и объем экономических потерь; обобщать отечественную и зарубежную практику	ПК-13.1 Демонстрирует знания методов анализа и оценки рисков
	ПК-13.2 Способен осуществлять оценку

таможенно-тарифной политики и опыт проведения международных валютных, финансовых и кредитных операций	вероятности наступления рисковых ситуаций

Пусть ожидаемый доход по активу "X" имеет распределение со средним значением 20% и стандартным отклонением 30%. Текущая цена актива составляет 100 млн. долл. Необходимо на конец года:
- рассчитать и построить график функции распределения F(x) на интервале от 0 до 240 млн. долл.;
- оценить вероятность того, что убыток к концу года составит более 20 млн. долл. (вероятность цены актива меньше 80 млн. долл.);
Результаты расчетов представить графически.

5.Задание на оценку знаний методов анализа и оценки рисков

Компетенция	Индикатор достижения компетенции
ПК-13 Способен анализировать риски, вероятность и объем экономических потерь; обобщать отечественную и зарубежную практику таможенно-тарифной политики и опыт проведения международных валютных, финансовых и кредитных операций	ПК-13.1 Демонстрирует знания методов анализа и оценки рисков

Поясните, что собой представляет принцип диверсификации?

Каким образом данный принцип используется при формировании портфеля ценных бумаг?

6.Задание на оценку знаний методов анализа и оценки рисков и способности выполнять экономические расчеты бизнес-проектов

Компетенция	Индикатор достижения компетенции
ПК-13 Способен анализировать риски, вероятность и объем экономических потерь; обобщать отечественную и зарубежную практику таможенно-тарифной политики и опыт проведения международных валютных, финансовых и кредитных операций	ПК-13.1 Демонстрирует знания методов анализа и оценки рисков
ПК-15 Способен осуществлять разработку проектных решений, разделов бизнес-планов организации	ПК-15.2 Способен выполнять экономические расчеты бизнес-проектов

Какова сущность анализа чувствительности?

Каким образом данный метод используется для анализа рисков инвестиционного проекта?

Является ли анализ чувствительности обязательный разделом бизнес-плана?

7.Задание на оценку способности осуществлять оценку вероятности наступления рисковых ситуаций и выполнять экономические расчеты бизнес-проектов

Компетенция	Индикатор достижения компетенции
ПК-13 Способен анализировать риски, вероятность и объем экономических потерь; обобщать отечественную и зарубежную практику таможенно-тарифной политики и опыт проведения международных валютных, финансовых и кредитных операций	ПК-13.2 Способен осуществлять оценку вероятности наступления рисковых ситуаций
ПК-15 Способен осуществлять разработку проектных решений, разделов бизнес-планов организации	ПК-15.2 Способен выполнять экономические расчеты бизнес-проектов

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

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

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

4. Файл и/или БТЗ с полным комплектом оценочных материалов прилагается.