

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ,
МИНИСТЕРСТВО НАУКИ, ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ И ИННОВАЦИЙ
КЫРГЫЗСКОЙ РЕСПУБЛИКИ

МОО ВО Кыргызско-Российский Славянский университет
имени первого Президента Российской Федерации Б.Н. Ельцина



Современные технологии и модели риск-менеджмента мирового финансового рынка

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой	Экономической теории		
Учебный план	g380401_24_12э обкф.plx Направление подготовки 38.04.01 - РФ, 580100 - КР Экономика Магистерская программа "Оценка бизнеса и корпоративные финансы"		
Квалификация	магистр		
Форма обучения	очная		
Общая трудоемкость	3 ЗЕТ		
Часов по учебному плану	108	Виды контроля	в семестрах
в том числе:		зачет с оценкой 1	
аудиторные занятия	28		
самостоятельная работа	79,9		

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>. <Семестр на курсе>)	1 (1.1)		Итого	
Неделя	18			
Вид занятий	уп	рп	уп	рп
Лекции	12	12	12	12
Практические	16	16	16	16
Контактная работа в период теоретического обучения	0,1	0,1	0,1	0,1
В том числе инт.	6	6	6	6
В том числе в форме практ. подготовки	2		2	
Итого ауд.	28	28	28	28
Контактная работа	28,1	28,1	28,1	28,1
Сам. работа	79,9	79,9	79,9	79,9
Итого	108	108	108	108

Программу составил(и):

к.э.н., доцент, Краснов А.Ю.



Рецензент(ы):

Рабочая программа дисциплины

разработана в соответствии с ФГОС 3++:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 11.08.2020 г. № 939)

составлена на основании учебного плана:

Направление подготовки 38.04.01 - РФ, 580100 - КР Экономика

Магистерская программа "Оценка бизнеса и корпоративные финансы"

утвержденного учёным советом вуза от 30.08.2025 протокол № 15

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Протокол от 27.08.2025 г. № 1

Срок действия программы: 2025-2029 уч.г.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент Краснов А.Ю.



Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель УМС

____ 2026 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2026-2027 учебном году на заседании кафедры

Протокол от ____ 2026 г. № ____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Краснов А.Ю.

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель УМС

____ 2027 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2027-2028 учебном году на заседании кафедры

Протокол от ____ 2027 г. № ____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Краснов А.Ю.

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель УМС

____ 2028 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2028-2029 учебном году на заседании кафедры

Протокол от ____ 2028 г. № ____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Краснов А.Ю.

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

Председатель УМС

____ 2029 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2029-2030 учебном году на заседании кафедры

Протокол от ____ 2029 г. № ____
Зав. кафедрой к.э.н., доцент Краснов А.Ю.

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1	Цель дисциплины: получение студентами прочных теоретических знаний и практических навыков в области оценки и управления рисками объектов и процессов на современных глобальных финансовых рынках путем применения наиболее передовых технологий и моделей управления рисками.
1.2	Задачи дисциплины: изучение теоретических и методологических основ системного анализа, моделирования и управления рисками систем и процессов на современных международных финансовых рынках; изучение теоретических основ разработки и внедрения современных систем управления рисками в виде различных технологий и моделей; освоение практического блока заданий с использованием программных продуктов, обеспечивающих проведение анализа, оценки и управления рисками.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП

Цикл (раздел) ООП:		Б1.В.ДВ.02
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:	
2.1.1	Информационные технологии в экономической науке и практике	
2.1.2	Эконометрика (продвинутый уровень)	
2.1.3	Макроэкономика	
2.1.4	Микроэкономика	
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	
2.2.1	Управление финансовым оздоровлением бизнеса	
2.2.2	Финансовая стратегия и финансовая политика корпорации	
2.2.3	Технологии управления финансовыми рисками	
2.2.4	Современные финансовые рынки	
2.2.5	Управление стоимостью компании	
2.2.6	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы	

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ПК-2: Способен обосновать выбор инструментов и продуктов на финансовых рынках для принятия инвестиционных и финансовых решений

Знать:

Уровень 1	Понятие и основное содержание финансовых продуктов и услуг реализуемых участниками финансовых рынков.
-----------	---

Уметь:

Уровень 1	Обоснованно аргументирует выбор финансовых инструментов для принятия решений, в том числе инвестиционных.
-----------	---

Владеть:

Уровень 1	Навыками оценки и мониторинга ситуации на финансовых рынках для своевременной корректировки финансовой/инвестиционной стратегии.
-----------	--

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

3.1	Знать:
3.1.1	современные принципы организации управления рисками в организации;
3.1.2	виды рисков, методы выявления и оценки риска;
3.1.3	финансирование риска;
3.1.4	страхование рисков;
3.1.5	оценку эффективности методов управления рисками и страхования;
3.1.6	управление инвестиционными рисками.
3.2	Уметь:
3.2.1	выявлять риск-проблему и оценивать возможности увеличения доходности предприятий или ее уменьшения;
3.2.2	сформировать систему эффективного управления рисками с использованием современных методов страхования рисков (диверсификации, лимитирования, устранения рисков путем самострахования и передачи рисков страховым компаниям).
3.3	Владеть:

3.3.1	приемами решения различных вопросов управления рисками (финансовыми, экологическими, политическими, транспортными, имущественными, торговыми, коммерческими, инвестиционными, а также рисками, связанными с покупательной способностью денег, инфляционными и дефляционными, валютными, рисками ликвидности, упущенной выгоды, рисками снижения доходности, прямых финансовых потерь, процентными, кредитными, биржевыми).
-------	--

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Пр. подг.	Примечание
	Раздел 1. Особенности современного риск-менеджмента на международном финансовом рынке							
1.1	Риски и неопределенность на международном финансовом рынке. Классификация рисков /Лек/	1	2		Л1.1Л2.1Л3.1 Э1	2		Прблемная лекция с элемнтами могового штурма
1.2	Риски и неопределенность на международном финансовом рынке. Классификация рисков /Пр/	1	2		Л1.2Л2.1Л3.1 Э1			
1.3	Риски и неопределенность на международном финансовом рынке. Классификация рисков /Ср/	1	18		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1			
1.4	Специфика деятельности современных институтов международного финансового рынка как фактор риск-менеджмента /Лек/	1	2		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1			
1.5	Специфика деятельности современных институтов международного финансового рынка как фактор риск-менеджмента /Пр/	1	2		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1	2		Кейс-задание
1.6	Специфика деятельности современных институтов международного финансового рынка как фактор риск-менеджмента /Ср/	1	18		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1			
	Раздел 2. Технологии и модели риск-менеджмента на мировом финансовом рынке							
2.1	Статистические и аналитические методы и модели по определению и оценке риска предприятия /Лек/	1	4		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1			
2.2	Статистические и аналитические методы и модели по определению и оценке риска предприятия /Пр/	1	8		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1	2		Кейс-задание
2.3	Статистические и аналитические методы и модели по определению и оценке риска предприятия /Ср/	1	24		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1			
2.4	Экспертные и графоаналитические методы и модели по определению и оценке риска предприятия /Лек/	1	4		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1			

2.5	Экспертные и графоаналитические методы и модели по определению и оценке риска предприятия /Пр/	1	4		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3. 1 Э1			
2.6	Экспертные и графоаналитические методы и модели по определению и оценке риска предприятия /Ср/	1	19,9		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3. 1 Э1			
2.7	/КрТО/	1	0,1		Л1.1 Л1.2Л2.1Л3. 1 Э1			
2.8	/ЗачётСОц/	1			Л1.1 Л1.2Л2.1Л3. 1 Э1			

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

5.1. Контрольные вопросы и задания

Вопросы для проверки уровня ЗНАТЬ:

1. Риск: сущность риска, событие риска, последствия риска.
2. Условия риска как объективные условия деятельности и развития организации.
3. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
4. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.
5. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.
6. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска.
7. Существенные признаки рисков. Влияние риска на эффективность управления.
8. Управление рисками и регулирование рисков.
9. Организация как объект управления рисками.
10. Классификация факторов риска по степени непосредственного воздействия на эффективность управления.
11. Структурные и процессуальные факторы риска: проблемы идентификации и оценки.
12. Использование теории жизненного цикла организации при анализе и планировании рисков.
13. Подходы к управлению рисками: интенсивный, экстенсивный.
14. Классификации рисков в управлении: признаки классификации, принципы использования.
15. Взаимосвязь структурных и процессных рисков в управлении организацией.
16. Аксиоматика управления рисками.
17. Виды деятельности по управлению рисками.
18. Взаимосвязь планирования в управлении рисками и планирования развития организации.
19. Метод избежания рисков.
20. Метод принятия рисков на себя.
21. Метод предотвращения убытков.
22. Метод уменьшения размера убытков.
23. Метод страхования.
24. Метод самострахования.
25. Метод передачи рисков.
26. Принципы использования и комбинирования методов управления рисками.
27. Методологические принципы оценки рисков.
28. Количественные методы оценки рисков.
29. Качественные методы оценки рисков.
30. Использование моделирования в управлении рисками.
31. Уточнение стратегии организации при разработке программы управления рисками.
32. Предварительный отбор рисков при разработке программы управления рисками.
33. Разработка плана превентивных мероприятий программы управления рисками.
34. Анализ рисков как этап разработки программы управления рисками.
35. Контроль и пересмотр программы управления рисками.
36. Оценка эффективности программы управления рисками.
37. Особенности управления рисками в финансовой и инвестиционной сферах деятельности организации.
38. Риск в управлении прямыми и портфельными инвестициями.
39. Распределение рисков между участниками проекта.
40. Классификация рисков производственной деятельности.
41. Области применения статистических методов при анализе рисков.
42. Сущность статистических методов анализа рисков.
43. Оценка степени риска по совокупности статистических критериев.
44. Области применения анализа безубыточности в риск-менеджменте.
45. Сущность анализа безубыточности в оценке рисков.

46. Оценка степени риска предпринимательского проекта.

47. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределенности и риска минимаксными методами.

Вопросы для проверки уровня УМЕТЬ и ВЛАДЕТЬ в приложении.

5.2. Темы курсовых работ (проектов)

Курсовые проекты не предусмотрено

5.3. Фонд оценочных средств

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ТЕКУЩЕЙ АТТЕСТАЦИИ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

«Современные технологии и модели риск-менеджмента мирового финансового рынка»

ТЕСТЫ

1. Что характеризует показатель цены риска?

- Наиболее ожидаемый результат инновации, ее полезность.
- Математическое ожидание потерь в результате возникновения рисков ситуации.
- Максимальные потери в ходе реализации инновации.
- Затраты на снижение риска.
- Сумму затрат на покрытие ущерба в случае возникновения рисков ситуации.

2. Какие задачи включает в себя анализ рисков?

- Идентификацию и классификацию рисков по причинам их возникновения, оценку возможности их возникновения (степени риска) и предполагаемых потерь (меры риска), а также выбор наиболее эффективных мер управления рисками.
- Идентификацию и классификацию рисков по причинам их возникновения. в. Оценку возможности возникновения рисков (степени риска) и предполагаемых потерь от них (меры риска).
- Выбор наиболее эффективных мер управления рисками.
- Классификацию рисков по причинам их возникновения, оценку возможности их возникновения (степени риска) и предполагаемых потерь (меры риска).

3. В каком порядке реализуются этапы метода балльной оценки рисков инновационного проекта?

- Определение списка факторов, определяющих степень риска проекта - разработка состава показателей, характеризующих риск по каждому фактору - оценка влияния каждого показателя по факторам и факторов на обобщающую оценку степени риска - разработка шкалы оценок по каждому показателю - формирование методики расчета обобщающей оценки риска.
- Формирование методики расчета оценки риска - определение списка фак-торов, определяющих степень риска проекта - разработка состава показателей, характеризующих риск по каждому фактору - оценка влияния каждого показателя по факторам и факторов на обобщающую оценку степени риска - разработка шкалы оценок по каждому показателю.
- Определение списка факторов, определяющих степень риска проекта - раз-работка состава показателей, характеризующих риск по каждому фактору - разработка шкалы оценок по каждому показателю - оценка влияния каждого показателя по факторам и факторов на обобщающую оценку степени риска -формирование методики расчета обобщающей оценки риска.
- Определение списка факторов, определяющих степень риска проекта - разработка состава показателей, характеризующих риск по каждому фактору - разработка шкалы оценок по каждому показателю - формирование методики расчета оценки риска - оценка влияния каждого показателя по факторам и факторов на обобщающую оценку степени риска.
- Определение состава показателей, характеризующих риск по каждому фактору - разработка шкалы оценок по каждому показателю - формирование методики расчета оценки риска - оценка влияния каждого показателя по факторам - оценка влияния факторов на обобщающую оценку степени риска.

4. Как отразится на статьях баланса закупка оборудования за наличный расчет:

- Увеличит стоимость активов и сократит размер заемных средств.
- Увеличит стоимость активов и сократит размер собственных средств.
- Увеличит одну статью и сократит на ту же сумму другую статью актива. г. Увеличит одну статью и сократит на ту же сумму другую статью источников капитала.
- Увеличит одну из статей оборотного капитала и собственного капитала.

5. Как отразится на статьях баланса закупка сырья и материалов в кредит:

- Увеличит на одну и ту же сумму активы и заемные средства.
- Увеличит на одну и ту же сумму активы и собственные средства.
- Увеличит одну статью и сократит на ту же сумму другую статью актива. г. Увеличит заемный капитал и сократит на ту же сумму собственный капитал. д. Увеличит одну статью собственного капитала и сократит на ту же сумму статью основного капитала.

6. Выпуск организацией облигаций приведет к изменению в составе:

- Собственного капитала.
- Оборотных активов.
- Долгосрочных обязательств.
- Краткосрочных обязательств.
- Оборотного капитала.

7. Потоком реальных денег (Cash Flow) по проекту связанному с выводом организации из предкризисного состояния называется:
- Разность между притоком и оттоком денежных средств по финансовой деятельности.
 - Разность между притоком и оттоком денежных средств от инвестиционной и операционной деятельности в каждом периоде осуществления проекта.
 - Разность между притоком и оттоком денежных средств от инвестиционной деятельности.
 - Разность между притоком и оттоком денежных средств ото всех видов деятельности в каждом периоде осуществления проекта.
 - Разность между притоком и оттоком денежных средств от инвестиционной финансовой деятельности.
8. Нарождающуюся цивилизацию называют цивилизацией:
- «Информационной».
 - «Технологической».
 - «Человека».
 - «Космической».
 - «Знания и риска».
9. Кто установил существование длинных волн, или больших циклов конъюнктуры?
- Австрийский экономист Й. А. Шумпетер.
 - Советский экономист Н. Д. Кондратьев.
 - Российский экономист С. Ю. Глазьев.
 - Французский экономист М. Жугляр.
 - Американский экономист Д. Кейнси.
10. Как Н. Д. Кондратьев назвал обнаруженные им циклические экономические изменения?
- Длинные волны, или большие циклы конъюнктуры.
 - Средние циклы.
 - Промышленно-капиталистические циклы.
 - Промышленные циклы (волны).
 - Короткие циклы (волны).
11. Согласно выявленной Н.Д. Кондратьевым закономерности («второй эмпирической правильности»), на участке повышательных волн больших циклов социальные потрясения в жизни общества
- незначительны;
 - крупные;
 - отсутствуют;
 - происходят случайным образом;
 - зависят от организации управления инновационной активностью.
12. Согласно выявленной Н. Д. Кондратьевым закономерности («третьей эмпирической правильности»), на понижательном участке волны больших циклов наблюдается ...
- депрессия сельского хозяйства;
 - крупные социальные потрясения в жизни общества;
 - глубокие изменения в технике (технологии) на основе появления; кардинальных изобретений и открытий, радикальных нововведений;
 - интенсивное развитие сельского хозяйства;
 - интенсивными изменениями в организации промышленного производства.
13. Какое из определений наиболее точно выражает сущность понятия «технологический уклад» в экономике?
- Преобладающий технический уровень производства, средняя степень переработки и использования ресурсов, средний уровень квалификации рабочей силы и научно-технического потенциала.
 - Наиболее высокий технический уровень производств, максимальный уровень переработки и использования ресурсов, наиболее высокий уровень квалификации рабочей силы и научно-технического потенциала.
 - Единый технический уровень производств, связанных вертикальными и горизонтальными потоками однородных ресурсов, базирующихся на общих ресурсах рабочей силы и общем научно-техническом потенциале.
 - Совокупность производственно-хозяйственных систем, обеспечивающих рост эффективности общественного производства.
 - Совокупность предприятий, обеспечивающих формирование основ нового технологического уклада.
14. Что относится к альтернативным направлениям инновационной деятельности, осуществляемым в целостной системе управления инновациями?
- Диффузия инноваций.
 - Нововведения-продукты и модификация продуктов (включая сферу услуг).
 - Нововведения-процессы.
 - Поисковые НИОКР.
 - Коммерциализация новаций.
15. Ядром какого технологического уклада стало развитие железнодорожного транспорта?

- а. Первого.
- б. Второго.
- в. Третьего.
- г. Четвертого.
- д. Пятого.

16. В каком из представленных ниже вариантов перечислены в правильном порядке явления, характерные для больших циклов конъюнктуры?

- а. Депрессия сельского хозяйства - Крупные потрясения в жизни общества - Глубокие изменения в технике и технологии производства.
- б. Крупные потрясения в жизни общества - Депрессия сельского хозяйства - Глубокие изменения в технике и технологии производства.
- в. Крупные потрясения в жизни общества - Глубокие изменения в технике и технологии производства - Депрессия сельского хозяйства.
- г. Глубокие изменения в технике и технологии производства - Депрессия сельского хозяйства - Крупные потрясения в жизни общества.
- д. Глубокие изменения в технике и технологии производства - Рост сельского хозяйства - Крупные потрясения в жизни общества.

17. На какой фазе жизненного цикла рисков ситуации не реализуется этап анализа рисков инновационной деятельности?

- а. Признаки возникновения рисков ситуации.
- б. Разрешение рисков ситуации.
- в. Развитие рисков ситуации.
- г. Анализ рисков инновационной деятельности осуществляется в течение всего жизненного цикла рисков ситуации.
- д. Сигналы о возможности возникновения рисков ситуации.

18. Какие стратегии обеспечивают возможность преодолеть накапливающийся технологический разрыв организации?

- а. Стратегии инновационного развития.
- б. Стратегии интенсивного развития.
- в. Стратегии диверсификации.
- г. Стратегии интеграционного развития.
- д. Стратегии развития НИОКР.

19. Проектный инновационный потенциал - это ...

- а. потенциал, концентрирующийся в рамках одного отдельного проекта;
- б. возможности, которые могут быть реализованы в рамках инновационного проекта;
- в. ресурсы, имеющиеся у организации на момент начала реализации инновационного проекта;
- г. ресурсы, выступающие ограничениями на инновационный проект;
- д. знания и опыт инновационной деятельности, способствующие разработке проекта.

20. В какой последовательности осуществляется цепочка трансформаций от цели к инновационной стратегии?

- а. Общая цель организации - Инновационная стратегия организации - Инновационная цель - Стратегический план реализации инновации.
- б. Инновационная цель организации - Инновационная стратегия организации - Общая цель - Стратегический план реализации инновации.
- в. Общая цель организации - Инновационная цель - Инновационная стратегия организации - Стратегический план реализации инновации.
- г. Общая цель организации - Стратегический план реализации инновации - Инновационная стратегия организации - Инновационная цель.
- д. Стратегический план реализации инновации - Общая цель организации - Инновационная стратегия организации - Инновационная цель.

21. Какова первая стадия жизненного цикла инновации?

- а. Создание новшества.
- б. Коммерциализация новшества (выведение на рынок).
- в. Приобретение новшества потребителем.
- г. Освоение (внедрение) новшества.
- д. Потребление новшества (включая обновление другой продукции или технологии).

22. Какова вторая стадия жизненного цикла инновации?

- а. Создание новшества.
- б. Коммерциализация новшества (выведение на рынок).
- в. Приобретение новшества потребителем.
- г. Освоение (внедрение) новшества.
- д. Потребление новшества (включая обновление другой продукции или технологии).

23. Что понимается под коммерциализацией инноваций?

- а. Сделка по продаже объектов интеллектуальной собственности.

- б. Рекламная компания по продвижению объектов новой техники и технологии.
в. Совокупность маркетинговых и организационных мероприятий, обеспечивающих распространение новшеств в научно-технической сфере.
г. Процесс обеспечения коммерческого использования новшеств на рынке.
д. Посредничество на рынке интеллектуальной собственности.
24. Что включает процесс рутинизации технологии?
а. Широкое применение нововведений-процессов в стабильно функционирующих подразделениях организаций.
б. Автоматизацию и механизацию операций основного технологического процесса.
в. Автоматизацию и механизацию операций вспомогательных и обслуживающих технологических процессов.
г. Автоматизацию и механизацию операций основного, вспомогательных и обслуживающих технологических процессов.
д. Обучение большого числа квалифицированных работников, способных применять на практике разработанные новые технологии и владеющих приемами эксплуатации новой техники.
25. Какова основная цель функционирования инкубатора бизнеса?
а. Выращивание новых предприятий.
б. Обеспечение новым предприятиям преимуществ на рынке.
в. Помощь предприятию в ведении плановой и учетной деятельности.
г. Продвижение продукции новых предприятий на рынок.
д. Повышение квалификации сотрудников предприятия.
26. Какой из методов управления рисками невозможно применить при управлении рисками локального инновационного проекта?
а. Резервирование.
б. Распределение рисков.
в. Страхование рисков.
г. Лимитирование.
д. Самострахование.
27. Какие показатели сопоставляются при обосновании инновационных решений с помощью методов управления рисками?
а. Мера риска и полезность инновации.
б. Мера риска и степень риска.
в. Вероятность возникновения рисков ситуации и ее последствия.
г. Вероятности неблагоприятного и благоприятного исходов рисков ситуации.
д. Мера риска и зона риска.
28. Какие из перечисленных методов не относятся к рейтинговым методам оценки риска?
а. Скоринг.
б. Интервальное оценивание.
в. Анкетирование.
г. Интервью.
д. Ранкинг.
29. Какие задачи включает в себя анализ рисков?
а. Идентификацию и классификацию рисков по причинам их возникновения, оценку возможности их возникновения (степени риска) и предполагаемых потерь (меры риска), а также выбор наиболее эффективных мер управления рисками.
б. Идентификацию и классификацию рисков по причинам их возникновения. в. Оценку возможности возникновения рисков (степени риска) и предполагаемых потерь от них (меры риска).
г. Выбор наиболее эффективных мер управления рисками.
д. Классификацию рисков по причинам их возникновения, оценку возможности их возникновения (степени риска) и предполагаемых потерь (меры риска).
30. Финансово-эксплуатационные потребности организации - это:
а. Потребность организации в заемных средствах на один цикл деятельности. б. Потребность организации в оборотных средствах на один цикл деятельности.
в. Потребность вложения средств, отраженная дебиторской задолженностью.
г. Недостаток материальных оборотных средств организации.
д. Недостаток оборотных средств организации, не вернувшихся в денежную форму за один цикл деятельности.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Вопросы промежуточной аттестации

1. Риск: сущность риска, событие риска, последствия риска.
2. Условия риска как объективные условия деятельности и развития организации.
3. Основные этапы эволюции теории управления рисками.
4. Определение риска с позиции теории рационального поведения человека.
5. Взаимосвязь риска и неопределенности в управлении.

6. Классификация ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска.
7. Существенные признаки рисков. Влияние риска на эффективность управления.
8. Управление рисками и регулирование рисков.
9. Организация как объект управления рисками.
10. Классификация факторов риска по степени непосредственного воздействия на эффективность управления.
11. Структурные и процессуальные факторы риска: проблемы идентификации и оценки.
12. Использование теории жизненного цикла организации при анализе и планировании рисков.
13. Подходы к управлению рисками: интенсивный, экстенсивный.
14. Классификации рисков в управлении: признаки классификации, принципы использования.
15. Взаимосвязь структурных и процессных рисков в управлении организацией.
16. Аксиоматика управления рисками.
17. Виды деятельности по управлению рисками.
18. Взаимосвязь планирования в управлении рисками и планирования развития организации.
19. Метод избежания рисков.
20. Метод принятия рисков на себя.
21. Метод предотвращения убытков.
22. Метод уменьшения размера убытков.
23. Метод страхования.
24. Метод самострахования.
25. Метод передачи рисков.
26. Принципы использования и комбинирования методов управления рисками.
27. Методологические принципы оценки рисков.
28. Количественные методы оценки рисков.
29. Качественные методы оценки рисков.
30. Использование моделирования в управлении рисками.
31. Уточнение стратегии организации при разработке программы управления рисками.
32. Предварительный отбор рисков при разработке программы управления рисками.
33. Разработка плана превентивных мероприятий программы управления рисками.
34. Анализ рисков как этап разработки программы управления рисками.
35. Контроль и пересмотр программы управления рисками.
36. Оценка эффективности программы управления рисками.
37. Особенности управления рисками в финансовой и инвестиционной сферах деятельности организации.
38. Риск в управлении прямыми и портфельными инвестициями.
39. Распределение рисков между участниками проекта.
40. Классификация рисков производственной деятельности.
41. Области применения статистических методов при анализе рисков.
42. Сущность статистических методов анализа рисков.
43. Оценка степени риска по совокупности статистических критериев.
44. Области применения анализа безубыточности в риск-менеджменте.
45. Сущность анализа безубыточности в оценке рисков.
46. Оценка степени риска предпринимательского проекта.
47. Выбор оптимального проекта развития предприятия в условиях неопределенности и риска минимаксными методами.

5.4. Перечень видов оценочных средств

Тесты, контрольные вопросы, задачи, ситуационные задания.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Под ред. И.В. Ларионовой	Риск-менеджмент в коммерческом банке : учебник	М.: Кнорус 2014
Л1.2	Ю. Э. Слепухина ; [науч. ред. А. Ю. Казак]	Риск-менеджмент на финансовых рынках : учеб. пособие	Изд во Урал. ун-та 2015

6.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Шапкин А.С., Шапкин В.А.	Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: монография	2015

6.1.3. Методические разработки

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
--	---------------------	----------	-------------------

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
ЛЗ.1	Балдин К.В.	Управление рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие	2012
6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"			
Э1	www.consultant.ru - Справочная правовая система «Консультант Плюс» www.ach.gov.ru - официальный сайт Счетной палаты Российской Федерации. www.government.kg - Официальный сайт Правительства Кыргызской Республики http://www1.minfin.kg - Официальный сайт Министерства финансов Кыргызской Республики www.nalog.kg - Официальный сайт Федеральной налоговой службы. www.finnadzor.kg - Официальный сайт Государственной службы финансового регулирования и надзора за финансовым рынком Кыргызской Республики. www.kazna.kg - Официальный сайт республиканского казначейства при Минфине Кыргызской Республики. www.ffms.ru - Официальный сайт Федеральной службы по финансовым рынкам. http://www.stat.kg - Официальный сайт Национальной службы государственной статистики Кыргызской Республики.		
6.3. Перечень информационных и образовательных технологий			
6.3.1 Компетентностно-ориентированные образовательные технологии			
6.3.1.1	Традиционные образовательные технологии – лекции, семинары, лабораторные работы репродуктивного типа, ориентированные прежде всего на сообщение знаний и способов действий, передаваемых студентам в готовом виде и предназначенных для воспроизводящего усвоения и разбора конкретны		
6.3.1.2	Инновационные образовательные технологии – занятия в интерактивной форме, которые формируют системное мышления и способность генерировать идеи при решении различных творческих задач. К ним относятся электронные тексты лекций с презентациями и проведение мозгового штурма по отдельным проблемам финансового менеджмента для предприятий различных отраслей экономики, а также разбор практических ситуаций из электронных источников и средств массовой информации, видео материалов новостного и художественного характера.		
6.3.1.3	Информационные образовательные технологии – самостоятельное использование студентом компьютерной техники и интернет-ресурсов для выполнения практических заданий и самостоятельной работы.		
6.3.2 Перечень информационных справочных систем и программного обеспечения			
6.3.2.1	www.consultant.ru - Справочная правовая система «Консультант Плюс»		
6.3.2.2	www.ach.gov.ru - официальный сайт Счетной палаты Российской Федерации.		
6.3.2.3	www.government.kg - Официальный сайт Правительства Кыргызской Республики		
6.3.2.4	http://www1.minfin.kg - Официальный сайт Министерства финансов Кыргызской Республики		
6.3.2.5	www.nalog.kg - Официальный сайт Федеральной налоговой службы.		
6.3.2.6	www.finnadzor.kg - Официальный сайт Государственной службы финансового регулирования и надзора за финансовым рынком Кыргызской Республики.		
6.3.2.7	www.kazna.kg - Официальный сайт республиканского казначейства при Минфине Кыргызской Республики.		
6.3.2.8	www.ffms.ru - Официальный сайт Федеральной службы по финансовым рынкам.		
6.3.2.9	http://www.stat.kg - Официальный сайт Национальной службы государственной статистики Кыргызской Республики.		

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
7.1	Лекционная аудитория на 55 посадочных мест;
7.2	Компьютерный класс для проведения практических занятий, выполнения самостоятельной работы и просмотра фото-, аудио-, мультимедиа, видео-материалов;
7.3	Наглядные пособия (плакаты, схемы);
7.4	Интерактивная доска;
7.5	Проектор;

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)
МОДУЛЬНЫЙ КОНТРОЛЬ ПО ДИСЦИПЛИНЕ ВКЛЮЧАЕТ: 1. Текущий контроль: усвоение учебного материала на аудиторных занятиях (лекциях, практических занятиях, в том числе учитывается посещение и активность) и выполнение обязательных заданий для самостоятельной работы 2. Рубежный контроль: проверка полноты знаний и умений по материалу модуля в целом. Выполнение модульных контрольных заданий проводится в письменном виде и является обязательной компонентой модульного контроля. 3. Промежуточный контроль - завершенная задокументированная часть учебной дисциплины (5 семестр - экзамен) – совокупность тесно связанных между собой зачетных модулей.

ОСНОВНЫЕ ТРЕБОВАНИЯ К ПРОМЕЖУТОЧНОМУ КОНТРОЛЮ

При явке на экзамены и зачёты студенты обязаны иметь при себе зачётные книжки, которые они предъявляют экзаменатору в начале экзамена или зачета.

Преподавателю предоставляется право поставить зачёт без опроса по билету тем студентам, которые набрали более 60 баллов за текущий и рубежный контроли.

На промежуточном контроле студент должен верно ответить на теоретические вопросы билета и определить основные проблемы в развитии финансов и финансовой системы.

Студенты могут использовать технические средства, справочно-нормативную литературу, наглядные пособия, учебные программы.

Оценка промежуточного контроля:

- min 20 баллов - Вопросы для проверки уровня обученности ЗНАТЬ (в случае, если при ответах на заданные вопросы студент правильно формулирует основные понятия)

- 20-25 баллов – Задания для проверки уровня обученности УМЕТЬ и ВЛАДЕТЬ (в случае, если студент правильно формулирует сущность заданной в билете проблемы и дает рекомендации по ее решению)

- 25-30 баллов - Задания для проверки уровня обученности УМЕТЬ и ВЛАДЕТЬ (в случае полного выполнения контрольного задания)

ОСНОВНЫЕ ТРЕБОВАНИЯ К ТЕКУЩЕМУ КОНТРОЛЮ.

Для понимания материала и качественного его усвоения рекомендуется такая последовательность действий:

1. После прослушивания лекции и окончания учебных занятий, при подготовке к занятиям следующего дня, нужно сначала просмотреть и обдумать текст лекции, прослушанной сегодня.

2. При подготовке к следующей лекции, нужно просмотреть текст предыдущего материала, подумать о том, какая может быть тема следующей лекции.

3. В течение недели выбрать время для работы с рекомендуемой литературой.

4. При подготовке к практическим занятиям следующего дня, необходимо сначала прочитать основные понятия и подходы по теме домашнего задания. При выполнении задания нужно сначала понять, что в нем требуется, какой теоретический материал нужно использовать, наметить план решения.

5. Для подготовки к семинарским занятиям и выполнению самостоятельной работы необходимо сначала прочитать основные понятия и подходы по теме задания. Рекомендуется использовать методические указания по курсу, глоссарий, конспекты и тезисы лекций. При выполнении задания нужно сначала понять, что требуется в нем, какой теоретический материал нужно использовать, наметить план решения задачи, а затем приступить к изучению и сделать качественный вывод.

6. При подготовке к промежуточному и рубежному контролю нужно изучить теорию: определения всех понятий и подходы к оцениванию до состояния понимания материала и самостоятельно выполнить несколько типовых заданий из каждой темы. При изучении темы необходимо уметь качественно интерпретировать итог решения.

8. Отработки пропущенных занятий.

Контроль над усвоением студентами материала учебной программы дисциплины осуществляется систематически преподавателем кафедры и отражается в журнале преподавателя в баллах. Студент, получивший неудовлетворительную оценку по текущему материалу, обязан подготовить данный раздел и ответить по нему преподавателю на индивидуальном собеседовании. При фронтальном обучении неудовлетворительная оценка должна быть отработана в течение месяца со дня ее получения, при цикловом обучении - до конца цикла.

Пропущенная без уважительных причин лекция должна быть отработана методом устного опроса лектором или подготовки реферата по материалам пропущенной лекции в течение месяца со дня пропуска. Возможны и другие методы отработки пропущенных лекций (опрос на практических и лабораторных занятиях, тестовый контроль и т.д.).

Отработка семинарских занятий.

- Каждое занятие, пропущенное студентом без уважительной причины, отрабатывается в обязательном порядке. Отработки проводятся по расписанию кафедры, согласованному с деканатом.

- При фронтальном обучении пропущенные занятия должны быть отработаны в течение 10 дней со дня пропуска, при цикловом обучении - до конца цикла. Пропущенные студентом без уважительной причины практические занятия отрабатываются не более одного занятия в день. Пропущенные занятия по уважительной причине (по болезни, пропуски с разрешения деканата) отрабатываются по тематическому материалу без учета часов.

- Студент, не отработавший пропуск в установленные сроки, допускается к очередным занятиям только при наличии разрешения декана или его заместителя в письменной форме. Не разрешается устранение от очередного практического занятия студентов, слабо подготовленных к данным занятиям.

- Для студентов, пропустивших практические и лабораторные занятия из-за длительной болезни, отработка должна проводиться после разрешения деканата по индивидуальному графику, согласованному с кафедрой.

- В исключительных случаях (участие в межвузовских конференциях, соревнованиях, олимпиадах, дежурство и др.) декан и его заместитель по согласованию с кафедрой могут освобождать студентов от отработок некоторых пропущенных занятий.

РЕФЕРАТ

Рекомендации по написанию реферата.

1. Тема реферата выбирается в соответствии с Вашими интересами и должна соответствовать приведенному примерному перечню. Важно, чтобы в реферате: во-первых, были освещены как экономические, так и социальные стороны проблемы; а во-вторых, представлены как общетеоретические положения, так и конкретные примеры. Особенно приветствуется использование собственных примеров из окружающей Вас жизни.

2. Реферат должен основываться на проработке нескольких дополнительных к основной литературе источников. Как правило, это специальные монографии или статьи. Рекомендуется использовать также в качестве дополнительной

литературы научно-популярные журналы, а также газеты специализирующиеся на геологической тематике.

3. План реферата должен быть авторским. В нем проявляется подход автора, его мнение, анализ проблемы.

4. Все приводимые в реферате факты и заимствованные соображения должны сопровождаться ссылками на источник информации.

5. Недопустимо просто скопировать реферат из кусков заимствованного текста. Все цитаты должны быть представлены в кавычках с указанием в скобках источника и страницы. Отсутствие кавычек и ссылок означает плагиат и, в соответствии с установившейся научной этикой, считается грубым нарушением авторских прав.

6. Реферат оформляется в виде текста на листах стандартного формата (А-4) шрифтом TimesNewRoman, 14. Начинается с титульного листа, в котором указывается название вуза, учебной дисциплины, тема реферата, фамилия и инициалы студента, номер академической группы или название кафедры, год и географическое место местонахождения вуза. Затем следует оглавление с указанием страниц разделов. Сам текст реферата желательно подразделить на разделы: главы, подглавы и озаглавить их. Приветствуется использование в реферате количественных данных и иллюстраций (графики, таблицы, диаграммы, рисунки).

7. Завершают реферат разделы "Заключение" и "Список использованной литературы". В заключении представлены основные выводы, ясно сформулированные в тезисной форме и, обычно, пронумерованные.

8. Список литературы должен быть составлен в полном соответствии с действующим стандартом (правилами), включая особую расстановку знаков препинания. Для этого достаточно использовать в качестве примера любую книгу изданную крупными научными издательствами: "Наука", "Прогресс", "Основы геологии", и др. Или приведенный выше список литературы.

Примерное содержание работы:

Наименование: Объем: 13-15 стр.

- Введение (цели, задачи) 1-2 стр.

- Основная часть 10-12 стр.

- Заключение 1-2 стр.

- Список использованной литературы 1стр.

9. Инструкция докладчикам.

- сообщать новую информацию;

- использовать технические средства;

- знать и хорошо ориентироваться в теме всего доклада;

- уметь дискутировать и быстро отвечать на вопросы;

- четко выполнять установленный регламент: докладчик - 7 мин.; дискуссия - 5 мин.;

Необходимо помнить, что выступление состоит из трех частей: вступление, основная часть и заключение. Вступление помогает обеспечить успех выступления по любой тематике. Вступление должно содержать:

- название презентации;

- сообщение основной идеи;

- современную оценку предмета изложения;

- краткое перечисление рассматриваемых вопросов;

- живую интересную форму изложения;

Основная часть, в которой выступающий должен глубоко раскрыть суть затронутой темы, обычно строится по принципу отчета. Задача основной части - представить достаточно данных для того, чтобы слушатели и заинтересовались темой и захотели ознакомиться с материалами. При этом логическая структура теоретического блока не должны даваться без наглядных пособий, аудио - визуальных и визуальных материалов.

Заключение - это ясное четкое обобщение и краткие выводы, которых всегда ждут слушатели.

КОЛЛОКВИУМ (устный)

При проведении коллоквиума по темам дисциплины предлагаются вопросы для опроса из списка ФОС. Задачи коллоквиума:

Коллоквиум ставит следующие задачи:

• Проверка и контроль полученных знаний по изучаемой теме или разделу;

• Расширение проблематики в рамках дополнительных вопросов по теме или разделу;

• Углубление знаний при помощи использования дополнительных материалов при подготовке к занятию; Студенты должны продемонстрировать умения работы с различными видами источников (Статистические данные, данные Министерства финансов КР, Государственной налоговой службы, НБКР и др.)

Студент может себя считать готовым к сдаче коллоквиума по избранной работе, когда у него есть им лично составленный и обработанный конспект сдаваемой работы, он знает структуру работы в целом, содержание работы в целом или отдельных ее разделов; умеет раскрыть рассматриваемые проблемы и высказать свое отношение к прочитанному и свои сомнения, а также знает, как убедить преподавателя в правоте своих суждений.

МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ ИЗУЧЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Изучение учебной дисциплины «Современные технологии и модели риск-менеджмента мирового финансового рынка» предполагает овладение материалами лекций, учебника, программы, работу студентов в ходе проведения семинарских занятий, а также систематическое выполнение тестовых и иных заданий для самостоятельной работы студентов.

В ходе лекций раскрываются основные вопросы в рамках рассматриваемой темы, делаются акценты на наиболее сложные и интересные положения изучаемого материала, которые должны быть приняты студентами во внимание. Материалы лекций являются основой для подготовки студента к семинарским занятиям и выполнения заданий самостоятельной работы.

Основной целью семинарских занятий является контроль за степенью усвоения пройденного материала, ходом выполнения студентами самостоятельной работы и рассмотрение наиболее сложных и спорных вопросов в рамках темы семинарского

занятия.

Самостоятельная работа студентов включает - подготовку к семинарским занятиям в соответствии с вопросами, представленными в УМК по дисциплине, изучение нормативных правовых актов, выполнение заданий для самостоятельной работы студентов, решение тестов и др.

Задания для самостоятельной работы выполняются студентом в письменном виде. Некоторые задания для самостоятельных работ предусматривают также обсуждение и презентацию полученных результатов на семинарских занятиях. Работа выполняется с использованием текстового редактора MS WORD, MS EXCEL - для таблиц, диаграмм и т.д., MS PowerPoint - для подготовки слайдов и презентаций.

При необходимости в процессе работы над заданием студент может получить индивидуальную консультацию у преподавателя.

Кроме того, предусмотрено проведение индивидуальной работы (консультаций) со студентами в ходе изучения материала данной дисциплины.

Промежуточный и текущий контроль осуществляется преподавателем в ходе учебного процесса на семинарских занятиях, при проведении индивидуальных консультаций, а также по итогам выполнения самостоятельных работ. Также для текущего контроля используются тесты, подготовленные по всем темам дисциплины. Тестирование может осуществляться с использованием персональных компьютеров.