МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Магнитогорский государственный технический университет им. Г.И. Носова»

УТВЕРЖДЕНО
Ученым советом МГТУ им. Г.И. Носова
Протокол № 3 от 15 февраля 2023 г.

И.о. ректора МГТУ им. Г.И. Носова,
председатель ученого совета

_____ Д.В. Терентьев

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ОСНОВНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ

Направление подготовки
38.04.01 ЭКОНОМИКА

Направленность (профиль) программы
ФИНАНСОВЫЕ ТЕХНОЛОГИИ И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ В БИЗНЕСЕ

Магнитогорск, 2023

ОП-ЭЭм-23-2

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
УНИВЕРСАЛЬНЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ		
УК-1 –Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий		
Методология и методы научного исследования		
УК-1.1	Анализирует проблемную ситуацию как систему, выявляя ее составляющие и связи между ними	***Теоретические вопросы для проведения промежуточной аттестации:*** 1 Генезис науки, наука и научная деятельность, ее цель и задачи. 2 Функционирование науки: методологические основы и структура научной деятельности, статическая и динамическая модели науки. 3 Научные подходы: системный, ситуационный, проектный, программно-целевой. 4 Научные парадигмы: вклад Я. Корнаи в развитие научной методологии. 5 Научные теории и концепции как существенный элемент научной методологии. 6 Научные проблемы и гипотезы. 7 Научная трактовка понятий критериев, ограничений и методов экономических исследований. 8 Системы фундаментальных и прикладных, теоретических и экспериментальных исследований в экономике. 9 Ключевые характеристики нормативного и позитивного подхода в экономической науке. 10 Объект, предмет, цель и задачи экономической науки. 11 Приоритеты и ориентиры в экономических исследованиях. 12 Язык науки и естественный язык: методологические проблемы изучения научного языка. 13 Построение, проверка и подтверждение гипотез как основа научной методологии. ***Тестовые задания:*** 1 Виды познавательной деятельности человека: а) философское познание; б) религиозное познание; в) научное познание; г) художественное познание; д) верны все ответы. 2 Наука – это: а) деятельность по получению нового знания; б) результат деятельности по получению нового знания; в) сумма знаний, лежащих в основе научной картины мира; г) верны все ответы. 3 Фундаментальные исследования в науке – это:

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		а) исследования, ориентированные на производство новых знаний независимо от их применения; б) исследования, ориентированные на применение новых знаний для достижения практических целей; в) исследования, ориентированные на создание новых отраслей науки и новых направлений научных исследований; г) верны все ответы. 4 Научный подход, изучающий события реальной жизни с поддающимися проверке выводами: а) нормативный подход; б) позитивный подход; в) системный подход; г) верны все ответы. 5 Система принципов, способов организации и построения теоретической и практической деятельности, а также учение об этой системе: а) концепция; б) методология; в) методика; г) парадигма; д) гипотеза; е) верны все ответы. 6 Основной вклад в развитие научной методологии внес: а) Аристотель; б) Платон; в) Сократ; г) Гегель; д) Кант; е) верны все ответы. 7 Предметом экономической науки является: а) изучение исторического процесса возникновения, развития и смены экономических концепций; б) изучение хозяйства, управления хозяйством, отношений между людьми, а также между людьми и окружающей средой, которые возникают в процессе производства, распределения, обмена, потребления продукта (услуг, благ); в) формулировка и теоретический анализ исходных гипотез; г) верны все ответы. 8 К числу научных подходов к экономических исследованиях относится: а) программно-целевой; б) ситуационный; в) системный; г) проектный; д) верны все ответы. 9 Научное предположение, выдвигаемое для объяснения какого-либо явления и требующее проверки на опыте и

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		теоретического обоснования для того, чтобы стать достоверной научной теорией или концепцией – это: а) критерий; б) приоритет; в) альтернатива; г) гипотеза; д) ориентир; е) верны все ответы. 10 Цель экономической науки: а) изучение основных экономических течений в процессе их становления и развития; б) углубление и расширение знаний по экономической теории; в) расширение кругозора в области общих и специальных экономических наук; г) повышение общей и экономической культуры человека; д) верны все ответы. 11 Виды гипотез в науке: а) общие гипотезы; б) частные гипотезы; в) ad hoc – гипотезы; г) верны все ответы; д) верны ответы а) и б); е) верны ответы а) и в); ж) верны ответы б) и в). 12 Методы научных исследований: а) индукция; б) дедукция; в) абдукция; г) верны все ответы. ***Примерные индивидуальные домашние задания (ИДЗ):*** 1 Система научных исследований в экономике. 2 Закономерности и тенденции развития экономической мысли. 3 Методология как учение о системе принципов, способов организации и построения теоретической и практической деятельности. 4 Особенности формирования и применения нормативного подхода в экономической науке. 5 Особенности формирования и применения позитивного подхода в экономической науке. 6 Особенности формирования и применения системного подхода в экономической науке. 7 Научная парадигма и ее развитие в обозримой исторической ретроспективе. 8 Экономическая теория как форма научного знания, дающая целостное представление о закономерностях и существенных

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>связях исследуемых экономических объектов, процессов и явлений.
9 Научная проблема как элементы методологии экономических исследований, ее проявления в различные исторические эпохи.
10 Основные этапы развития экономической науки и их особенности.
11 Соотношение эмпирического и теоретического уровней познания.
12 Сущность рационализма в науке.
13 Научные проблемы и проблемные ситуации в науке.
14 Верификация и фальсификация в науке.
15 Взгляды Т. Куна на понятие парадигмы научных исследований.
16 «Научное сообщество» и «Невидимый колледж» как элементы научной системы.</td></tr>
<tr><td>УК-1.2</td><td>Критически оценивает надежность источников информации, работает с противоречивой информацией из разных источников, определяет пробелы в информации, необходимой для решения проблемной ситуации, и проектирует процессы по их устранению</td><td>Теоретические вопросы для проведения промежуточной аттестации:
1 Формирование новой парадигмы научно-технического развития.
2 Междисциплинарные исследования: предметно-ориентированные и проблемно-ориентированные научные исследования.
3 Научные исследования как генератор новых наукоемких технологий в условиях перехода к V и VI технологическим укладам.
4 Научные исследования как основа перехода к цифровой экономике в XXI веке.
5 Информационные общество и общество знаний: от постиндустриального к информационному обществу.
6 Дисциплинарная наука и расщепление единой картины мира. Пути восстановления единой науки.
7 Редукционизм и элевационизм как методологические принципы современных научных исследований.
8. Цифровая экономика XXI века и сущность информационного обеспечения исследований.
9. Информационные технологии как важный компонент научных исследований. Информационные технологии XXI века. Цифровая экономика.

Практические задания для проведения промежуточной аттестации:
Задание. Используя методику ABC-анализа и XYZ-анализа провести объемно-стоимостное исследование поставок материалов в организацию и выделить наиболее важные потоки. Провести стоимостное ранжирование поставок и построить кумулятивную кривую плотности распределения исследуемой характеристики. Исходные данные сведены в таблицу 1.

Таблица 1 – ABC-анализ данных о поставщиках организации
<table>
<tr><th>Поставщики</th><th>Оборот,
тыс. руб.</th><th>Оборот, %
общего оборота</th><th>Оборот
кумулятивный, %</th></tr>
<tr><td>П – 8</td><td>56804</td><td>32,70</td><td>32,
0</td></tr>
<tr><td>П – 17</td><td>43622</td><td>25,11</td><td>57,81</td></tr>
<tr><td>П – 21</td><td>42717</td><td>24,59</td><td>82,40</td></tr>
<tr><td>П – 4</td><td>5815</td><td>3,35</td><td>85,75</td></tr>
<tr><td>П – 13</td><td>4485</td><td>2,58</td><td>88,33</td></tr>
</table></td></tr>
</table>

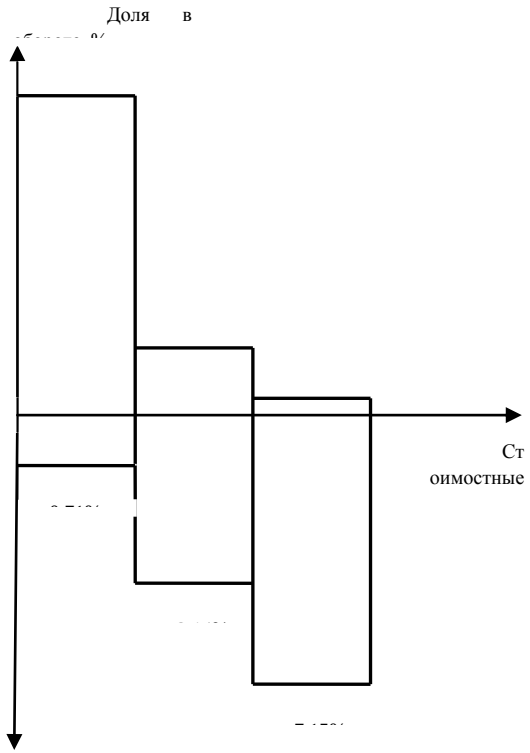
Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

П – 20	2939	1,70	90,03
П – 24	2701	1,55	91,58
П – 5	2540	1,46	93,04
П – 18	2478	1,43	94,47
П – 10	2259	1,30	95,77
П – 28	2173	1,25	97,02
П – 14	206	1,19	98,21
П – 26	437	0,25	98,46
П – 1	371	0,21	98,67
П – 19	333	0,19	98,86
П – 15	298	0,17	99,03
П – 7	276	0,16	99,19
П – 11	240	0,14	99,33
П – 22	222	0,13	99,46
П – 16	218	0,13	99,59
П – 27	135	0,08	99,67
П – 2	113	0,07	99,74
П – 6	104	0,06	9,80
П – 23	102	0,06	99,86
П – 9	76	0,04	99,90
П – 25	72	0,04	99,94
П – 12	60	0,03	99,97
П – 3	52	0,03	100,00
Сумма	173708	100,00	-

Полученные результаты классификации поставщиков сводятся в таблицу 2.

Таблица 2 – Классификация поставщиков организации

Категория поставщиков	Доля в обороте, %	Доля в общем числе поставщиков, %
A	82,40	10,71
B	15,81	32,14
C	1,79	57,15

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Полученную методом АВС классификацию поставщиков организации следует также представить графически, что обеспечивает большую наглядность в представлении результатов исследований (рисунок 1).  Рисунок 1 – Результаты АВС-анализа поставщиков организации Основная идея XYZ-анализа заключается в группировке исследуемых объектов по уровню однородности анализируемых параметров (по уровню коэффициента вариации). Алгоритм расчетов включает использование формул среднего значения параметров, среднеквадратического отклонения, вариации. Исходные данные и получаемые результаты для их анализа удобно сводить в специальную таблицу. Пример расчетов по методу XYZ представлен в таблице 3.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

Таблица 3 – Сведения XYZ-анализа данных о продажах товаров фирмой за первое полугодие

Позиция	Значение показателей x_i по месяцам, тыс. шт.						$\bar{x}$	σ	var	XYZ
	Янв	Февр	Март	Апр	Май	Июнь				
Товар 1	164	155	170	159	161	169	163,0	5.3	3%	X
Товар 2	271	238	321	256	292	248	271,0	28,2	10%	Y
Товар 3	75	27	124	36	141	99	90,7	42,8	47%	Z
Товар 4	64	50	44	91	49	114	68,7	25,6	7%	Z
Товар 5	352	404	371	390	405	366	381,3	19,8	5%	X
Товар 6	844	923	759	918	851	885	863,3	55,4	6%	X
Товар 7	522	714	548	486	668	525	577,2	99,8	17%	Y
Товар 8	480	399	462	510	488	447	464,3	35,3	8%	X
Товар 9	341	290	368	318	377	395	348,2	36,0	10%	Y
Товар 10	332	266	389	328	400	431	357,7	54,9	15%	Y
Товар 11	255	362	218	330	227	389	296,8	66,7	22%	Y
Товар 12	180	224	151	138	183	177	175,5	27,2	15%	Y
Товар 13	221	134	127	199	125	180	164,3	37,7	23%	Y
Товар 14	676	623	840	725	784	961	768,2	111,1	14%	Y
Товар 15	322	315	330	335	362	377	340,2	22,1	6%	X
Товар 16	255	127	96	249	288	104	186,5	79,0	42%	Z
Товар 17	883	920	891	852	877	922	890,8	24,4	3%	X
Товар 18	172	95	95	183	235	289	178,2	70,0	39%	Z
Товар 19	517	492	381	330	284	341	390,8	85,5	22%	Y
Товар 20	184	233	218	226	198	245	217,3	20,7	10%	Y

Величина среднего арифметического значений параметров $\bar{x}$ позволяет определить наиболее вероятный уровень значения исследуемого параметра. Величина среднего квадратического отклонения σ позволяет оценить меру рассеивания вариантов значений параметров относительно среднего арифметического. Коэффициент вариации var позволяет сравнить между собой стабильность значений параметров по нескольким исследуемым позициям, имеющим разные количественные характеристики.

В последней графе представленной таблицы 3 приведены результаты группировки исследуемых поставок товаров фирмы по величине коэффициента вариации var. Выбранные границы групп часто используются в практике коммерческой деятельности. В рассматриваемом примере в группу X попадают товары с коэффициентом вариации менее 10%. В группу Y – попадают товары с коэффициентом вариации от 10 до 25%. В группу Z – попадают товары с коэффициентом вариации более 25%.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

В исследованиях применяется совмещение (комбинирование) ABC-анализа и XYZ-анализа. Сначала проводится ABC-анализ исследуемых позиций за весь отчетный период. Затем проводится XYZ-анализ по тем же позициям и за тот же отчетный период, но отдельно по категориям A, B и C. После этого результаты совмещаются. При таком совмещении определяются 9 групп анализируемых позиций (таблица 4).

Таблица 4 – Группы анализируемых позиций с использованием методов ABC и XYZ

Параметры	X	Y	Z
A	AX	AY	AZ
B	BX	BY	BZ
C	CX	CY	CZ

Позиции категорий A и B составляют основные расходы предприятия, им должно уделяться наибольшее внимание при анализе и планировании. Использование XYZ- анализа позволяет точнее настроить систему управления расходами. При этом объемы расходов групп AX и BX имеют значительные величины и хорошо прогнозируются (стабильны). Позиции групп AY и BY имеют недостаточную стабильность при высоких уровнях значений. Позиции групп AZ и BZ при высоком уровне значений расходов отличаются низкой прогнозируемостью их конкретных значений. Позиции категории C могут составлять значительную часть расходов организации. Применение XYZ-анализа по позициям этой группы позволяет существенно сократить время на анализ, управление и контроль над расходами данной категории.

Тестовые задания:

1 Какой вид исследований предполагает расчленение, разложение изучаемого объекта на отдельные элементы, составляющие части:
а) индукция;
б) дедукция;
в) абдукция;
г) анализ;
д) синтез.
2 Какой вид исследований предполагает соединение расчлененных элементов изучаемого объекта в единое целое:
а) индукция;
б) дедукция;
в) абдукция;
г) анализ;
д) синтез.
3 Основная цель экономического анализа:
а) повышение эффективности функционирования предприятий;
б) поиск резервов совершенствования деятельности организаций;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) укрепление благосостояния собственников организации; г) повышение устойчивости функционирования организации; д) верны все ответы. 4 Основные принципы экономического анализа: а) научность; б) системность; в) комплексность; г) объективность; д) конкретность; е) верны все ответы. 5 Средние величины, используемые в системе экономических исследований: а) простая средняя арифметическая; б) среднемесячная взвешенная; в) средняя геометрическая; г) средняя хронологическая; д) средняя гармоническая; е) все ответы верны; ж) нет правильного ответа. 6 В научных исследованиях – упрощение действительности и представление ее в абстрагированном виде с отсечением второстепенных и малозначащих деталей: а) инструментарий исследования; б) механизм исследования; в) редукция; г) моделирование; д) абстракция; е) нет правильного ответа. 7 Форма представления экономико-математических моделей: а) графики; б) диаграммы; в) формулы; г) таблицы; д) все ответы верны; е) нет правильного ответа. ***Примерные индивидуальные домашние задания (ИДЗ):*** 1 Структуралистская концепция науки как попытка объединения статической и динамической модели. 2 Моделирование в науке. Экономико-математическое моделирование. 3 Различия неклассической науки и современной технонауки (на примере нанотехнологий).

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>4 Научно-технический прогресс в концепции устойчивого экономического развития.
5 Жесткие, гибкие и конвергентные технологии в современных научных исследованиях</td></tr>
<tr><td>УК-1.3</td><td>Разрабатывает и содержательно аргументирует стратегию решения проблемной ситуации на основе системного и междисциплинарного подходов; строит сценарии реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их устранения</td><td>

Практические задания для проведения промежуточной аттестации:

Задание. Используя методы маржинального анализа, разработать обоснованные управленческие решения промышленной компании по планированию и организации производства промышленной продукции. Необходимые исходные данные приведены в таблице 5. Для обоснования и подготовки краткосрочного управленческого решения по производству новой промышленной продукции необходимо определить:

- критическую точку (точку безубыточности) выпуска новой продукции при заданных условиях;
- объем выпуска и реализации новой продукции, обеспечивающий наибольшую годовую прибыль;
- объемы прибыли в планируемых условиях деятельности промышленного предприятия;
- объемы прибыли в оптимальных условиях деятельности промышленного предприятия;
- границы прибыльности бизнеса в условиях производства новой продукции.

Сделать выводы по работе и дать графическую интерпретацию полученных результатов расчетов.

Таблица 5 - Исходные показатели для анализа планируемого производства новой продукции в условиях промышленного предприятия

<table>
<tr><th rowspan="2">Наименование показателей</th><th colspan="6">В а р и а н т ы</th></tr>
<tr><th>1</th><th>2</th><th>3</th><th>4</th><th>5</th><th>6</th></tr>
<tr><td>1 Цена продукции (включая НДС), руб./ед.</td><td>2450</td><td>25
0</td><td>2550</td><td>2600</td><td>2650</td><td>2700</td></tr>
<tr><td>2 Ставка НДС, %</td><td>18</td><td>18</td><td>18</td><td>18</td><td>18</td><td>18</td></tr>
<tr><td>3 Переменные затраты, руб./ед.</td><td>1220</td><td>1270</td><td>1330</td><td>1360</td><td>1390</td><td>1710</td></tr>
<tr><td>4 Постоянные затраты, руб./год</td><td>617800</td><td>625500</td><td>631000</td><td>635000</td><td>637500</td><td>639500</td></tr>
<tr><td>5 Предполагаемый годовой объем продаж, ед.</td><td>925</td><td>948</td><td>978</td><td>1055</td><td>165</td><td>1080</td></tr>
<tr><td>6 Оценка емкости рынка за предыдущий год (для всех вариантов), руб./год</td><td colspan="6">$O_{год}^{спрос} = -617 \cdot Q + 3147500;$</td></tr>
<tr><td>7 Прогнозируемая емкость рынка на планируемый год, %</td><td>90</td><td>95</td><td>100</td><td>105</td><td>110</td><td>115</td></tr>
<tr><td>8 Прогноз емкости рынка имеет устойчивый характер на интервале планирования, д.</td><td colspan="6">$Q_{год} = 75...2500$</td></tr>
</table>

</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		В основу рассматриваемого метода управленческого анализа положено разделение производственных и внепроизводственных расходов на переменные и постоянные расходы в зависимости от изменения объемов производства, а также использование категории маржинального дохода. Маржинальный доход – это выручка предприятия за вычетом переменных издержек: $Д_{марж} = \left(O_{реал} - S_{НДС}^{реал}\right) - З_{пер}$, (1) где $Д_{марж}$ - маржинальный доход предприятия, руб.; $O_{реал}$ - объем выручки от реализации продукции, руб.; $S_{НДС}^{реал}$ - расчетная сумма НДС по реализованной продукции, руб.; $З_{пер}$ - переменные расходы (затраты) предприятия на производство и реализацию продукции, руб. Удельный маржинальный доход (или маржинальный доход на единицу продукции) представляет собой разность между ценой единицы этой продукции и переменными затратами на нее: $Д_{марж}^{уд} = \left(O_{реал}^{уд} - S_{НДС,уд}^{реал}\right) - З_{пер}^{уд}$, (2) где $Д_{марж}^{уд}$ - удельный маржинальный доход, руб./ед.; $O_{реал}^{уд}$ - удельный объем реализации продукции, руб./ед.; $S_{НДС,уд}^{реал}$ - удельная величина расчетной суммы НДС по реализации единицы продукции, руб./ед.; $З_{пер}^{уд}$ - удельные переменные расходы на производство и реализацию продукции, руб./ед. Таким образом, маржинальный доход предприятия включает не только прибыль, но и постоянные издержки (затраты, расходы). В свою очередь, величина прибыли предприятия может быть выражена следующими формулами: $Пр_{реал} = Д_{марж} - З_{пост}$; (3) $Пр_{реал}^{уд} = Д_{марж}^{уд} - З_{пост}^{уд}$, (4) где $Пр_{реал}$ - общая прибыль от реализации продукции, руб.; $Пр_{реал}^{уд}$ - удельная прибыль от реализации продукции, руб./ед.; $З_{пост}$ - постоянные расходы (затраты) на производство и реализацию продукции, руб.; $З_{пост}^{уд}$ - удельные постоянные расходы (затраты) на производство и реализацию продукции, руб./ед. В свою очередь, объемы выручки и затрат предприятия можно представить с учетом объемов производства:

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		$O_{реал} = Ц \cdot Q$; (5) $З_{пер} = З_{пер}^{уд} \cdot Q$, (6) где $Ц$ - цена единицы продукции, руб./ед.; Q - объем производства и реализации продукции, ед. Отсюда, формулу (3) можно представить в виде $Пр_{реал} = \left(O_{реал} - S_{НДС}^{реал}\right) - З_{пер} - З_{пост}$; (7) $Пр_{реал} = \left(O_{реал} - S_{НДС}^{реал}\right) - З_{общ}$, (8) где $З_{общ}$ - общая сумма затрат (расходов) предприятия, руб. В свою очередь $З_{общ} = З_{пер} + З_{пост}$. (9) С формулами (5) и (6) выражение (7) примет следующий вид: $Пр_{реал} = \left(Ц \cdot Q - S_{НДС}^{реал}\right) - З_{пер}^{уд} \cdot Q - З_{пост}$. (10) Хорошее представление о порядке образования маржинального дохода и прибыли предприятия дает схема, представленная на рисунке 2.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

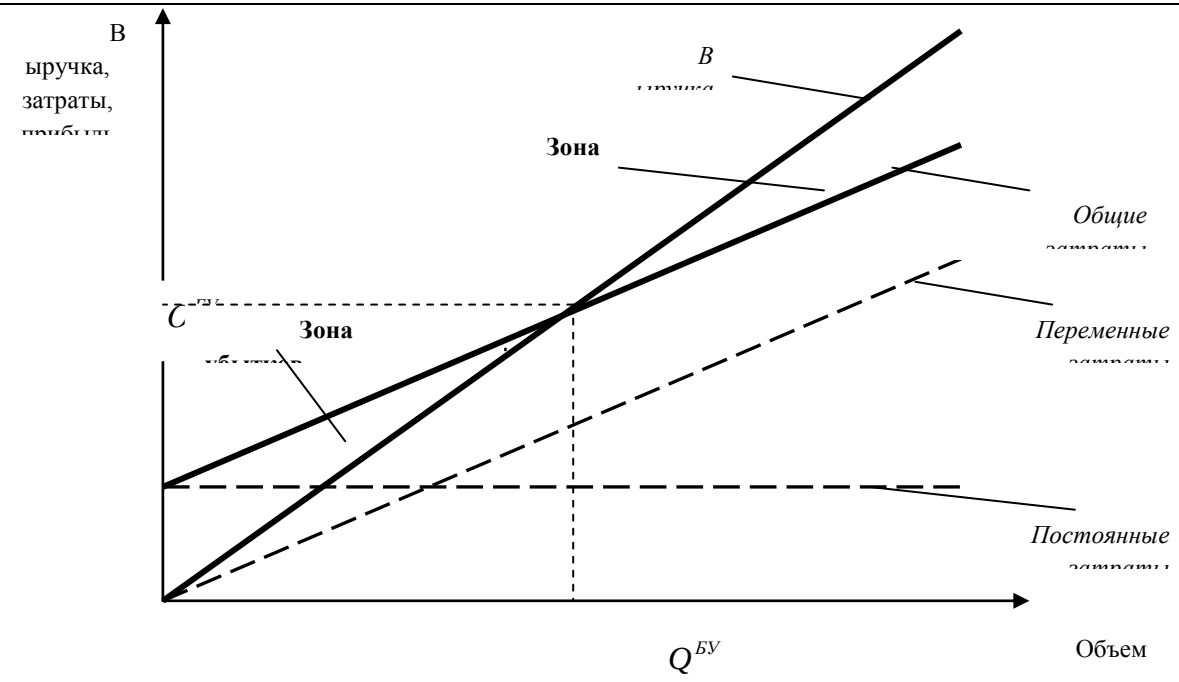


Рисунок 2 – Зависимость между прибылью, затратами и объемом производства и реализации продукции

Очевидно, что при определенном объеме производства и реализации продукции Q прибыль от реализации продукции оказывается равной нулю ($Пр_{реал}$ = 0), при этом оказываются равными выручка от реализации продукции ($О_{реал}$) за вычетом НДС ($S_{НДС}^{реал}$) и общих затрат ($З_{общ}$). Такой объем производства и реализации продукции предприятия называется точкой безубыточности ($Q^{БУ}$):

$$\left(Ц \cdot Q^{БУ} - S_{НДС}^{реал}\right) = З_{пер}^{уд} \cdot Q^{БУ} - З_{пост}. \qquad (11)$$

На практике определение такой точки безубыточности позволяет оценить возможности организации безубыточного производства продукции определенного вида при заданных ценах, уровне постоянных и переменных затрат и разрабатывать

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		обоснованные варианты управленческих решений. В тех случаях, когда проводится маржинальный анализ по нескольким видам продукции, формулы (10) и (11) принимают вид: $$Пр_{реал} = \sum_{i=1}^{n}\left(Ц_i \cdot Q_i - S_{НДС,i}^{реал}\right) - \sum_{i=1}^{n}\left(З_{пер,i}^{уд} \cdot Q_i\right) - З_{пост}\,, \qquad (12)$$ $$\sum_{i=1}^{n}\left(Ц_i \cdot Q_i^{БУ} - S_{НДС,i}^{реал}\right) = \sum_{i=1}^{n}\left(З_{пер,i}^{уд} \cdot Q_i^{БУ}\right) - З_{пост}\,. \qquad (13)$$ На графике (рисунок 2) хорошо видны зона убытков и зона безубыточности бизнеса, что позволяет четко представить его возможности. К основным возможностям маржинального анализа относят следующие: - определение безубыточного объема продаж (порога рентабельности, порога окупаемости издержек); - определение зоны безопасности (безубыточности) бизнеса; - определение необходимого объема продаж для получения заданной величины прибыли; - определение критического уровня постоянных затрат при заданном уровне маржинального дохода; - определение критической цены реализации при заданном объеме продаж (спроса) и уровне переменных и постоянных издержек. С помощью метода маржинального анализа могут обосновываться и другие управленческие (проектные) решения: выбор вариантов изменения производства, технологий, ассортимента товаров, определение цены на новое изделие (работы, услуги), выбор вариантов установки оборудования, приобретения комплектующих деталей, оценка эффективности принятия дополнительного заказа и т.п. ***Тестовые задания:*** 1 Какой вид исследований предполагает расчленение, разложение изучаемого объекта на отдельные элементы, составляющие части: а) индукция; б) дедукция; в) абдукция; г) анализ; д) синтез. 2 Какой вид исследований предполагает соединение расчлененных элементов изучаемого объекта в единое целое: а) индукция; б) дедукция; в) абдукция; г) анализ; д) синтез. 3 Основная цель экономического анализа: а) повышение эффективности функционирования предприятий;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		б) поиск резервов совершенствования деятельности организаций; в) укрепление благосостояния собственников организации; г) повышение устойчивости функционирования организации; д) верны все ответы. 4 Основные принципы экономического анализа: а) научность; б) системность; в) комплексность; г) объективность; д) конкретность; е) верны все ответы. 5 Средние величины, используемые в системе экономических исследований: а) простая средняя арифметическая; б) среднемесячная взвешенная; в) средняя геометрическая; г) средняя хронологическая; д) средняя гармоническая; е) все ответы верны; ж) нет правильного ответа. 6 В научных исследованиях – упрощение действительности и представление ее в абстрагированном виде с отсечением второстепенных и малозначащих деталей: а) инструментарий исследования; б) механизм исследования; в) редукция; г) моделирование; д) абстракция; е) нет правильного ответа. 7 Форма представлена) графики; б) диаграммы; в) формулы; г) таблицы; д) все ответы верны; е) нет правильного ответа. 8 Процесс образования систем единиц совокупности, однородных в каком-либо существенном отношении, а также имеющих одинаковые или близкие значения систематизирующего признака: а) индексация; б) кластеризация;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) группировка; г) агрегирование; д) нет правильного ответа. 9 Характеристики общности в стохастическом моделировании, применяемые для обработки расчетных данных: а) середина интервала; б) мода; в) медиана; г) все ответы верны. 10 Характеристики разброса значений в стохастическом моделировании, применяемые для обработки расчетных данных: а) размах вариации; б) среднее линейное отклонение; в) дисперсия; г) среднеквадратическое отклонение; д) все ответы верны. 11 Научный метод установления связи различных данных исследования и измерения ее тесноты: а) регрессионный анализ; б) корреляционный анализ; в) дисперсионный анализ; г) факторный анализ; д) кластерный анализ; е) нет правильного ответа. 12 Научный метод установления аналитического выражения стохастической зависимости между исследуемыми признаками: а) регрессионный анализ; б) корреляционный анализ; в) дисперсионный анализ; г) факторный анализ; д) кластерный анализ; е) нет правильного ответа. 13 Научный метод многомерного анализа, предназначенный для группировки совокупности данных, элементы которой характеризуются многими признаками: а) регрессионный анализ; б) корреляционный анализ; в) дисперсионный анализ; г) факторный анализ; д) кластерный анализ; е) нет правильного ответа. 14 Статистический метод, позволяющий подтвердить или опровергнуть гипотезу о том, что две выборки данных относятся к

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		одной генеральной совокупности: а) регрессионный анализ; б) корреляционный анализ; в) дисперсионный анализ; г) факторный анализ; д) кластерный анализ; е) нет правильного ответа. ***Примерные индивидуальные домашние задания (ИДЗ):*** ИДЗ 1: Используя данные управленческого учета промышленной компании и методику ABC-анализа и XYZ-анализа провести объемно-стоимостное исследование поставок материалов в организацию и выделить наиболее важные потоки. Провести стоимостное ранжирование поставок и построить кумулятивную кривую плотности распределения исследуемой характеристики. ИДЗ 2: Используя данные управленческого учета промышленной компании и методику маржинального анализа провести исследование вопросов планирования и организации производства промышленной продукции (точка безубыточности, объем выпуска и реализации новой продукции, обеспечивающий наибольшую годовую прибыль, объемы прибыли в планируемых условиях деятельности, объемы прибыли в оптимальных условиях деятельности, границы прибыльности бизнеса). ИДЗ 3: Оценить уровень влияния отдельных *факторов* на уровень собираемости налогов в условиях районной ИФНС РФ (*результативный показатель* – объем налогов, уплаченных плательщиками в течение календарного года) с применением *метода цепных подстановок*, используя следующую детерминированную факторную модель: $\Sigma S_{бюдж} = \Sigma S_{нач} + \Sigma S_{тек} - \Sigma S_{кон}$, где $\Sigma S_{бюдж}$ - объем уплаченных налогов в течение календарного года, руб.; $\Sigma S_{нач}$ - задолженность по уплате налогов на начало года, руб.; $\Sigma S_{тек}$ - объем начисленных налоговых платежей в течение календарного года, руб.; $\Sigma S_{кон}$ - задолженность по уплате налогов на конец года, руб. Необходимые исходные данные для решения задачи представлены сведениями по работе условного объекта анализа – межрайонной ИФНС РФ за период, охватывающий два календарных года. Все налогоплательщики, поставленные на учет, по критериям товарооборота, прибыли и численности занятых разбиты на три основные категории в соответствии с методикой ABC-анализа. По указанным категориям необходимо произвести расчеты и сделать выводы о силе влияния факторов на показатель объема уплаченных за календарный год налогов, который характеризует уровень их собираемости. ИДЗ 4: Компания по производству синтетических моющих средств разрабатывает управленческое решение о производстве и отпуске продукции в торговую сеть. Среди прочих рассматривается вариант с изготовлением изделий R и W, для производства которых требуются компоненты X_1, X_2, X_3, X_4.Необходимо определить оптимальные годовые объемы

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		производства и реализации этих изделий в розничную сеть, используя метод линейного программирования. В качестве критерия оптимальности выбрать объем прибыли от поставок моющих средств в розничную сеть. Произвести расчет и дать его графическую интерпретацию. Предлагается для условий задачи сформировать следующую экономико-математическую модель для конкретных расчетов: $(P_R - CP_R)\cdot Q_R + (P_W - CP_W)\cdot Q_W \to \max$; $CP_R \cdot Q_R + CP_W \cdot Q_W \le CF_{LIM}$; $Q_R + Q_W \le Q_{LIM}$, где P_R и P_W - отпускная цена за одну упаковку, соответственно, изделий R и W (без НДС), руб./ед.; CP_R и CP_W - удельные издержки производства в расчете на одну упаковку, соответственно, изделий R и W , руб./ед.; Q_R и Q_W - оптимальные годовые объемы производства упаковок, соответственно, изделий R и W , ед.; Q_{LIM} - максимально возможный объем производства моющих средств марок R и W (производственная мощность компании), ед.; CF_{LIM} - максимально возможный объем финансирования производства изделий R и W для компании (собственные и заемные средства), руб./год.
УК-2 – Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла		
Инновационное предпринимательство		
УК-2.1	Формулирует на основе поставленной проблемы проектную задачу и способ ее решения через реализацию проектного управления	**Перечень теоретических вопросов к зачету:** 1. Сущность и свойства инноваций. 2. Модели инновационного процесса и их характеристика. 3. Роль предпринимателя в инновационном процессе. 4. Классификация инноваций и их характеристика. 5. Сущность и основные разделы бизнес-плана. 6. Основные виды маркетинговых исследований, их характеристика. 7. Методы маркетинговых исследований. 8. Оценка рынка и целевой сегмент. 9. Особенности продаж инновационных продуктов. 10. Методы разработки и жизненный цикл продукта. 11. Концепция Customer development. 12. Методы моделирования потребностей потребителей. 13. Источники и инструменты финансирования предпринимательских проектов. 14. Понятие и критерии оценки инвестиционной привлекательности предпринимательских проектов. 15. Денежные потоки предпринимательского проекта.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		16. Понятие и типология рисков предпринимательского проекта. 17. Методы количественного анализа рисков предпринимательского проекта. 18. Инновационная среда и ее структура. 19. Инновационный потенциал предпринимательского проекта (компании).
УК-2.2	Разрабатывает концепцию проекта в рамках обозначенной проблемы: формулирует цель, задачи, обосновывает актуальность, значимость, ожидаемые результаты и возможные сферы их применения	**Примерные практические задания для зачета:** 1. Поясните, к какой гипотезе и к какой модели инновационного процесса – «push» или «pull» относятся процессы, связанные с созданием: - светодиодного фонаря; - нержавеющей стали; - кондиционера; - DVD-дисков. 2. Проанализируйте и сравните, какое влияние на существующие рынки оказывают радикальные (базисные) и улучшающие (поддерживающие) инновации. Охарактеризуйте инновации, приведенные ниже, в зависимости от глубины вносимых изменений: - новая операционная система Windows 10, расширяющая возможности пользователя, в том числе сетевые, развитие технологий защиты и безопасности; - криптовалюта, представляющая собой цифровой актив, учет которого децентрализован, актив защищен от поддержки или кражи за счет использования криптографии и распределенной компьютерной сети. 3. Выясните, какой тип информации необходимо в первую очередь получить во время маркетингового исследования, если: - компания, занимающаяся разработкой приложения по доставке еды, нашла уникальную на рынке нишу - приготовление и доставка домашней еды по запросу соседей; - компания оценивает возможность открытия завода и переноса производства на локальный рынок для большего его освоения.
УК-2.3	Разрабатывает план реализации проекта с учетом возможных рисков реализации и возможностей их устранения, планирует необходимые ресурсы	**Примерные практические задания для зачета:** 1. В ходе подготовки обоснования предпринимательского проекта были рассмотрены условия снабжения производства необходимыми материалами и условия сбыта готовой продукции. Материалы, используемые в производстве, будут оплачены 60 % в текущем месяце, 40 % – в следующем. Запас сырья и материалов создается на месяц. Продукция будет реализована в том же месяце в кредит с оплатой покупателями через два месяца. Месячная периодичность закупок материалов и вывоза готовой продукции сохранится на весь период жизни проекта. Ежемесячный расход сырья и материалов составляет 1 500 тыс. руб.; ежемесячные продажи готовой продукции – 2 600 тыс. руб. Определите необходимую сумму финансовых средств, инвестируемых в предстоящем периоде в оборотный капитал. 2. Оцените уровень эффективности проекта, предполагающего приобретение оборудования, с двухлетним сроком реализации, используя показатели NPV и PI, если инвестиционные затраты составляют 1500 тыс. руб., дисконтная ставка – 11 %, величина чистого денежного потока за первый год – 950 тыс. руб. и за второй год – 600 тыс. руб.
УК-2.4	Осуществляет мониторинг хода	**Комплексное задание по разработке предпринимательского проекта и его презентации:** Разработайте и сформируйте PPT-презентацию Вашего сквозного проекта по следующим пунктам:

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	реализации проекта, корректирует отклонения, вносит дополнительные изменения в план реализации проекта, уточняет зоны ответственности участников проекта	- «наименование предпринимательского проекта, авторы»; - «маркетинг, оценка рынка» (продаваемый продукт, цена, каналы дистрибуции, продвижение); - «product development, разработка продукта» (традиционные аналоги, новизна, преимущества, инвестиционные затраты, производственная себестоимость); - «customer development, выведение продукта на рынок» (перечень мероприятий по выводу продукта на рынок, их стоимость).
УК-2.5	Предлагает процедуры и механизмы оценки качества проекта, инфраструктурные условия для внедрения результатов проекта	**Комплексное задание по разработке предпринимательского проекта и его презентации:** Разработайте и сформируйте PPT-презентацию Вашего сквозного проекта по следующим пунктам: - «инструменты привлечения финансирования» (виды источников финансирования, их преимущества и недостатки); - «оценка инвестиционной привлекательности проекта»; - «риски проекта» (основные риски и инструменты их преодоления).
УК-3 – Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели		
Инновационное предпринимательство		
УК-3.1	Вырабатывает стратегию командной работы и на ее основе организует отбор членов команды для достижения поставленной цели	**Перечень теоретических вопросов к зачету:** 1. Формирование и развитие команды. 2. Командный лидер, типы командного лидерства. 3. Бизнес-идея, основные методы ее генерирования. 4. Бизнес модель, элементы бизнес-модели. 5. Понятие и общая структура эффективных презентаций. 6. Виды презентаций и их характеристика. Понятие и особенности питч-сессии.
УК-3.2	Делегирует полномочия членам команды и распределяет поручения, организует и корректирует работу команды, дает обратную связь по результатам	**Примерные практические задания для зачета:** 1. Команда из семи человек трудилась над выполнением одного заказа. При этом каждый затратил 40 человеко-часов. Заказ принес компании 2000 млн. руб. Определите производительность труда каждого сотрудника в расчете на человеко-час. 2. Продумайте «презентацию идеи (Idea Pitch)» для компании X, которая разработала технологию управления скутером без участия человека. 3. Используя схему, изображенную ниже, раскройте императивные отличия предпринимателя от менеджера, промоутера и изобретателя. Определите, в чем разница между ними по следующим направлениям: - мотивация их действий; - методы реализации новой идеи; - использование ресурсов, формы и методы привлечения необходимых ресурсов, ответственность; -отношение к организационной структуре.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		 Рис. Матрица «Креативность – управленческие навыки»
УК-3.3	Организует обсуждение результатов работы, в т.ч. в рамках дискуссии с привлечением оппонентов	**Комплексное задание по разработке предпринимательского проекта и его презентации:** Разработайте и сформируйте PPT-презентацию Вашего сквозного проекта по следующим пунктам: - «команда проекта» (необходимые роли, обоснование их распределения между участниками команды); - «бизнес-идея, бизнес-модель, бизнес-план» (целевой потребитель, ценностное предложение, период реализации проекта).
УК-4 – Способен применять современные коммуникативные технологии, в том числе на иностранном(ых) языке(ах), для академического и профессионального взаимодействия		
Основы научной коммуникации		
УК-4.1	Устанавливает контакты и организует общение в соответствии с потребностями совместной деятельности, используя современные коммуникационные технологии	**Тест:** 1. Специфическая форма профессионального общения, основанная на обмене научной информацией – это а) массовая коммуникация б) научная коммуникация в) межкультурная коммуникация. 2. Мимика, жесты, фотодокументы, темп речи – это … средства научной коммуникации а) вербальные б) невербальные в) технические. 3.Что не является техническим средством научной коммуникации а) речь б) телеконференция в) электронные рассылки г) факс

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		4. Конфронтация лежит в основе … а) дискуссии б) полемики 5. Определите характер научной полемики по ее цели: победить любым путем, используя ложные доводы а) эвристический б) софистический в) аподиктический 6.Эвристический характер научная полемика обретает: а) когда цель полемики сопряжена с достижением истины, основанной на законах мышления и логических правилах игры; б) когда цель спора сводится к тому, чтобы склонить к своему мнению собеседника; в) когда цель – победить любым путем, преднамеренно используя ложные доводы. 7. Поиск научного согласия, формирование общего мнения – цель а) спора б) полемики в) дискуссии 8. Что не относится к сильным аргументам а) точно установленные факты б) выводы, подтвержденные экспериментом в) уловки и суждения, построенные на алогизмах г) заключения экспертов 9. Алогизм – это а) прием разрушения логики; б) прием логической аргументации, который представляет собой умозаключение, состоящее из трех суждений: двух посылок и вытекающего из них вывода; в) случайная, неосознанная или непреднамеренная логическая ошибка в мышлении (в доказательстве, в споре, диалоге); г) уловка, попытка получить неоправданное преимущество одной из сторон в научной дискуссии.
УК-4.2	Составляет деловую документацию, создает различные академические или профессиональные тексты на русском и иностранном языках	**Задание 1:** Найдите в интернете на сайтах ЭБС «Лань», «Киберленинка» или «elibrary» научные статьи по темам, близким к теме вашего научного исследования(1-2 статьи на выбор), и проанализируйте их. Проследите движение научной мысли от проблемной ситуации к выводам. Выпишите языковые средства тональности и оценочности: указание на отсутствие или неполноту знаний, на сомнение, предположение, гипотезу, опыт истории и др. Какие языковые средства используются для оценки целей, метода исследования, результатов деятельности? Как вводятся идея и гипотеза? Соблюдаются ли правила логической аргументации, используются ли приемы критической аргументации в статье? Сделайте выводы. Напишите научную статью по теме вашего
УК-4.3	Представляет результаты исследовательской и	**Задание 1:**. Найдите на сайте ЭБС «Лань» или библиотеке РИНЦ, elibrary статьи, содержащие дискуссию по вашей научной специальности, и проанализируйте их. Как выстроена аргументация в научной дискуссии? Дайте обзор основных точек зрения по данному предмету? В чем суть спора? Сформулируйте свою точку зрения. Кто из оппонентов более убедителен, на ваш взгляд? Что

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	проектной деятельности на различных публичных мероприятиях, участвует в академических и профессиональных дискуссиях на русском и иностранном языках	вы можете сказать о роли этой дискуссии в развитии науки. Приведите свои примеры актуальных для современной науки дискуссий. **Задание 2:** Подготовьте свое выступление на выбранную группой тему научной дискуссии
Иностранный язык в профессиональной деятельности		
УК-4.1	Устанавливает контакты и организует общение в соответствии с потребностями совместной деятельности, используя современные коммуникационные технологии	**1.Заполните пропуск. Выберите один вариант ответа.** 1. Teacher's job is very interesting, he .....a lot of people. a)is meeting b) meets c) meet d) met 2. ..... is generaly quiet, weakness is often not. a)strong b) strength c) a student d) study 3. Who usually ....quietly and pleasantly at the lessons? a)speaks b) does speak c) is speaking d) spoke 4. Now I .....on the light because it is dark in late autumn. a)am switching b) switch c) will switch d) has switch 5. That time tomorrow .....lunch at a cafe. a)we shall have b) we shall be having c) shall we be having d) has **2. Ответьте на вопросы:** 1. Where do English young men and women get higher education? 2. At what age do they enter a university? 3. What is the proportion of men and women attending English universities? 4. What subjects are considered to be arts subjects? 5. Why are the colleges of Oxford and Cambridge called residential institutions? 6. What is understood by tutors and the tutorial method? 7. Do tutors look after each student individually or after a small group of students? 8. How many terms is the University year divided into? 9. How long do they last? 10. What vacations (or holidays) have English students? 11. What do many English students do during their long summer holiday? 12. What do they call a person who has taken a degree? 13. What do the terms B.A., B. Sc., M.A. or M. SC. mean?
УК-4.2	Составляет деловую документацию, создает различные академические или профессиональные тексты на русском и иностранном языках	**1. Определите, к какому виду делового документа относится представленный ниже отрывок:** Dear Sirs, Our order No. 243A, sent to you on June 1st, should have been delivered by now, but there is no sign of the goods, although documents have been received by our bank, and we have your advice of dispatch. We promised to supply our own customers before July 5th and we are now placed in the very awkward position of having to tell them that the goods are not yet available. Please advise us by return what has gone wrong. Yours faithfully,

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		а) Letter of apology б) Letter of inquiry/request в) Letter of complaint г) CV **2. Выберите обозначения основных пунктов резюме для заполнения пропусков так, чтобы они отражали особенности оформления резюме.** ***Special skills, Education, References, Personal information, Qualifications, Personal qualities, Work experience, Objective*** Ivan Ivanov _____ Address: 201 Lenina Street, apt. 25, Moscow, 215315, Russia Telephone: home: +7-XXX-XXX-XXXX mobile: +7-XXX-XXX-XXXX Email: your.name@gmail.com Date of birth: 25th July 1985 Nationality: Russian Marital status: single _____ I am seeking a position with a company where I can use my ability to analyze data sets and prepare financial forecasts. _____ Lomonosov Moscow State University, department of Economics, Master's degree in Marketing (2001–2006). _____ Marketing Specialist courses in Moscow Marketing College, started in 2014 up to present _____ Company Name 1, 2012–present Moscow, Russia Financial analyst • Preparing business plans • Planning investment activities and budget • Analyzing data sets collected through all the departments www.englex.ru • Preparing financial forecasts • Preparing reports for the board of management Company Name 2, 2007–2011 Krasnodar, Russia Assistant manager _____ • Articulate • Broad-minded • Dependable • Determined • Initiative • Versatile _____ • Native Russian • Fluent English • Working knowledge of German (Basic knowledge) • Driving License (Category B) • Computer literacy (Microsoft Office, Outlook Express, 1C: Enterprise) • Hobbies: foreign languages, chess _____ PetrPetrov, BBB Solutions, +7-495 –XXX-XXXX, name@gmail.com
УК-4.3	Представляет результаты исследовательской и проектной	1. Прочитайте текст. Выберите один вариант ответа. Определите, являетсялиутверждение: ***Finding the first job isn't very difficult at all.*** a) ложным b) истинным c) в тексте нет информации **Looking for a job** 1.Esther Garcia graduated from university with a degree in telecommunications. But finding her first job was very hard.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	деятельности на различных публичных мероприятиях, участвует в академических и профессиональных дискуссиях на русском и иностранном языках	2. She searched all the job ads in the newspapers and on the internet. She made lots of applications to different companies. She also sent her resume to all big telecommunication companies. But most companies didn't even invite her for interview. It seemed that they only wanted to recruit people with job experience. 3. After several months, a finance company in Madrid offered Esther a place on a three-month graduate scheme. At the end of the three months, Esther was the only person out of ten trainees to be selected for a permanent job. Of course, Esther was very happy to accept. 2. Прочитайте текст. Выберите один вариант ответа. Определите, является ли утверждение: ***Therearemanyjobadsinthenewspapers.*** a) ложным b) истинным c) в тексте нет информации 3. Прочитайте текст. Выберитеодинвариантответа. Определите, являетсялиутверждение: ***Most employers invited Esther forthe interview.*** a) ложным b) истинным c) в тексте нет информации 4.Прочитайте текст. Выберите один вариант ответа. Определите, являетсялиутверждение: ***Esther was selected by the finance company in Madrid for a permanent job.*** a) ложным b) истинным c) в тексте нет информации Укажите, какой части текста (1, 2, 3) соответствует следующая информация: ***Job experience is an advantage when applying for work.*** a) 2 b) 3 c) 1
Эффективные коммуникации в бизнесе		
УК-4.1	Устанавливает контакты и организует общение в соответствии с потребностями совместной деятельности, используя современные коммуникационные технологии	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Коммуникация как основа деловых отношений. 2. Специфика и основные задачи деловой коммуникации. 3. Коммуникативные модели взаимодействия участников деловой коммуникации. 4. Способы передачи и приема информации. 5. Факторы эффективной коммуникации. 6. Элементы и этапы коммуникационного процесса. 7. Обратная связь в деловой коммуникации, условия ее эффективности. 8. Использование эффектов восприятия в деловом общении. 9. Коммуникативные барьеры в деловом общении, причины и условия возникновения. 10. Приемы устранения коммуникативных барьеров. 11. Вербальные средства делового общения.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		12. Стили и виды слушания в деловых коммуникациях. 13. Приемы активного слушания в деловом общении. 14. Роль невербальных средств в коммуникации, их классификация. 15. Проблема интерпретации невербальных средств в деловом общении. 16. Деловая беседа, этапы, принципы и правила проведения. 17. Правила и приемы эффективного телефонного общения. 18. Деловые переговоры: подготовка и проведение. 19. Формирование и совершенствование переговорного процесса. 20. Манипуляция, ее типы и признаки. Защита от манипуляций. 21. Организация и проведение делового совещания. 22. Способы нейтрализации «блокирующих ситуаций в ходе совещания. 23. Презентация как форма деловой коммуникации. 24. Самопрезентация в деловых контактах. 25. Специфика, возможности и ограничения письменной деловой коммуникации. 26. Внутренняя переписка: характеристика, особенности текста. 27. Внешняя переписка: характеристика, особенности текста, использование стандартных языковых формул (клише). 28. Основные требования к оформлению делового письма. 29. Основные виды официальных деловых писем. 30. Внутренние и внешние письменные коммуникации. 31. Психологическая основа и языковые средства публичного выступления. 32. Управление организационными коммуникациями. 33. Электронная коммуникация: сущность, особенности и функции. 34. Этические основы деловых коммуникаций. 35. Публичное выступление в системе деловых коммуникаций: методика и техника организации. 36. Техники эффективной деловой коммуникации при контакте с деловым партнером. 37. Условия эффективного речевого воздействия. 38. Коммуникативные навыки, используемые в деловой беседе. 39. Межкультурные различия в деловой коммуникации. 40. Взаимосвязь национальной ментальности и корпоративной культур
УК-4.2	Составляет деловую документацию, создает различные академические или профессиональные тексты на русском и иностранном языках	Тематика рефератов 1. Коммуникация как основа деловых отношений. 2. Специфика и основные задачи деловой коммуникации. 3. Коммуникативная культура современного специалиста. 4. Соблюдение норм языка и культуры речи в деловой коммуникации. 5. Коммуникативные модели взаимодействия деловых партнеров. 6. Обратная связь в деловой коммуникации, условия ее эффективности. 7. Убеждение в процессе делового общения. 8. Использование эффектов восприятия в деловом общении.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		9. Коммуникативные барьеры в деловой коммуникации и их преодоление. 10. Стратегии устных деловых взаимодействий. 11. Коммуникативные навыки, используемые в деловой беседе. 12. Деловые переговоры, их подготовка и проведение. 13. Коммуникативные эффекты ораторской речи в процессе публичного выступления. 14. Управление неформальными коммуникациями в организации. 15. Языковое своеобразие деловой переписки. 16. Этика и психология речевой деловой коммуникации. 17. Взаимное доверие как основа деловой этики. 18. Основные принципы письменных коммуникаций. 19. Языковое своеобразие деловой переписки. 20. Стратегии письменных деловых коммуникаций. Тематика эссе 1. Стили и виды слушания: сравнительный анализ. 2. Невербальные компоненты деловых коммуникаций: проблема интерпретации. 3. Деловая беседа и деловая дискуссия: общие и отличительные черты. 4. Как противостоять давлению в деловых переговорах? 5. Манипуляции, применяемые в деловых переговорах: распознавание и нейтрализация. 6. Как провести успешную презентацию? 7. Условия установления успешной телефонной коммуникации и их актуальность. 8. Деловая беседа по телефону: как избежать ошибок? 9. Деловая коммуникация в Интернет: за и против. 10. Этико-психологические принципы делового общения: актуальность в современных условиях. 11. Специфика процесса деловой коммуникации с представителями различных культур. 12. Вербальное межкультурное общение: проявление межкультурных различий в языке и ментальности. 13. Как избежать коммуникативных ошибок при кросс-культурном взаимодействии? 14. Специфика деловых переговоров с представителями Запада (США, страны Европы). 15. Специфика деловых переговоров с представителями Стран Востока. 16. Формулы речевого этикета в различных культурах: сравнительный анализ. 17. Факторы, влияющие на кросс-культурную коммуникацию: стереотипы, предрассудки, дискриминация. 18. Специфика невербальной коммуникации с представителями разных культур.
УК-4.3	Представляет результаты исследовательской и проектной	Кейс-задания Задание 1. Вам представлены мини-ситуации. Установите обратную связь, проверьте точность восприятия информации или узнайте дополнительную информацию с помощью

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	деятельности на различных публичных мероприятиях, участвует в академических и профессиональных дискуссиях на русском и иностранном языках	вопросов. Один из партнеров употребил какое-то незнакомое выражение или термин. Говорящий уклоняется от темы и не сообщает той информации, которую Вы от него ждете. Партнер только что произнес нечто, не очень-то согласующееся с его предыдущими утверждениями. Вы хотите это уточнить. Вам хотелось бы узнать мнение партнера о том, что Вами было высказано Невербальное поведение партнера подсказывает вам, что он обеспокоен какими-то Вашими словами. Вы хотите рассеять его сомнения, подозрения. Было высказано несколько положений, и Вы хотите привлечь к ним внимание. Партнер не согласился с частью из сказанного Вами, и Вы хотите уточнить причину этого неприятия. Партнер сделал общее утверждение относительно обсуждаемого вопроса, и Вы хотите поговорить об этом более конкретно. Вы сказали о некоторых преимуществах обсуждаемой идеи и хотите установить обратную связь с партнером. Задание 2. Проанализируйте представленную ситуацию и, используя упражнениетренинг «Как вы ответите на возражения», дайте разные варианты ответа. Представьте себе, что в ответ на Ваше предложение по цене Ваш партнер заявляет следующее: «Ваша цена очень высока. Мы вели переговоры с другой фирмой, они просят меньшую сумму и, кроме того, предложили меньшие сроки». Как Вы ответите на эти возражения? Способ оттягивания. Воздерживайтесь слишком рано говорить о цене. Сначала объясните, в чем заключается польза продукта, и только потом называйте цену. Не торопитесь сразу соглашаться с требованиями клиента, это делает Ваше предложение малоценным. Способ «сэндвича». «Поместите» цену между двумя «слоями», отражающими пользу для партнера. «Продавайте» свое коммерческое предложение, припася на «десерт» особенно привлекательный аргумент, подтверждающий необходимость принятия предложения и его выгоду для клиента. Способ сравнения. Соотнесите цену с пользой продукта, со сроком его эксплуатации, с иными расходами клиента: «Хотя новая вывеска стоит на X рублей больше, чем другая, зато она служит в два раза дольше, значит, вы дополнительно еще три года будете испытывать удовольствие, используя ее в работе». Способ деления. «Расшифруйте» цену. Разложите ее на более мелкие составляющие. Обращение эмоционального характера. Чаще взывайте к эмоциям партнеров. Дайте понять, что они достойны того, чтобы позволить себе нечто особенное. Способ подведения итогов. В правой колонке таблицы запишите все недостатки, которые перечислил клиент. Затем вместе с ним еще раз проанализируйте все достоинства и преимущества вашего предложения и перечислите их в левой колонке таблицы. После этого спросите его, неужели он хочет из-за единичных недостатков отказаться от такого количества преимуществ. Аргументы, указывающие на недостатки. В таблице укажите цену, которая устраивала клиента. Затем объясните ему, наличие каких недостатков или отсутствие каких преимуществ связано с более низкой ценой. При этом называйте исключаемое преимущество, зачеркивайте его в таблице красным маркером и комментируйте, что означает отсутствие данного преимущества. Согласительный способ. Воздерживайтесь от скидок, предлагайте иные бесплатные услуги. Уступка за уступку. Идите на уступки только в том случае, если объем заказа большой и, если за этим заказом поступят другие, не меньшие. Способ продажи отличий. Не продавайте цены! Продавайте те качества, продукты, достижения, сильные стороны, которые отличают Вашу фирму от других, например:

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		– интенсивность установочных и монтажных работ; – богатый опыт; – отзывы и рекомендации довольных сотрудничеством с Вами партнеров; – высококачественные консультации и классные специалисты; – систематическое обслуживание; – близость к клиенту с точки зрения местонахождения; – отраслевые ноу-хау и т.д.
УК-5 – Способен анализировать и учитывать разнообразие культур в процессе межкультурного взаимодействия		
Основы научной коммуникации		
УК-5.1	Ориентируется в межкультурных коммуникациях на основе анализа смысловых связей современной поликультуры и полиязычия	**Задание 1:** Найдите на сайте ЭБС «Лань» или библиотеке РИНЦ, elibrary статьи по вашей научной специальности и проанализируйте их. Как вы оцениваете силу аргументов в этой научной полемике? Соблюдают ли авторы законы аргументации: правила логической аргументации, критической аргументации. Применяется ли психологическая аргументация? Используют ли автор/авторы софизмы/паралогизмы? Выпишите из статьи специальные средства научного стиля. Выпишите из статьи языковые средства, с помощью которых авторы выражают свои эмоции и свое отношение к оппоненту. . **Задание 2:** Найдите на сайте ЭБС «Лань» или библиотеке РИНЦ, elibrary статьи по вашей научной специальности. Проанализируйте аргументы сторон (логическую, критическую и психологическую аргументацию). Протестируйте тексты на наличие паралогизмов и софизмов. Представьте свою точку зрения на вопрос. В чем причины появления подобных дискуссий
УК-5.2	Владеет навыками толерантного поведения при выполнении профессиональных задач	**Задание 1:** Подготовьте свое выступление на выбранную группой тему научной дискуссии. Проведите дискуссию, учитывая правила логической аргументации и этику межкультурных и межличностных отношений, и требования толерантности. **Задание 2:** Используя Российский индекс научного цитирования, найдите статьи, опубликованные за три последних месяца учеными университета или организации, в которой вы учитесь или работаете. На основе заголовков и резюме этих статей попробуйте выбрать одну статью для развлекательной новости и одну статью для познавательной новости в СМИ. Напишите текст новости. **Задание 3:** Придумайте заголовок и напишите ЛИД новости, по близкой вам проблематике. Продумайте, как могла бы звучать новость о вашей научной работе.
Иностранный язык в профессиональной деятельности		
УК-5.1	Ориентируется в межкультурных коммуникациях на основе анализа смысловых связей современной поликультуры и полиязычия	**1. Выберите реплику, наиболее соответствующую ситуации общения. Выберите один вариант ответа.** 1) A: Hi, Jim. Are you still looking for work? B: _____ a) No, thanks a lot, I'm fed up. b) As a matter of fact, I am. c) Yes, I do. 2) A: Do you have any career plans yet? B: _____

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		a) I'm sure, it will be well-paid. b) No, it doesn't appeal to me at all … c) Yes … I'd like to be my own boss one day. 3) A: The contract is ready. It can be signed. B: _____. a) Terrible! b) See you later! c) It's very good! We managed it within the agreed time . d) Don'tmentionit! **2. Закончите правило.** The passive voice is used to show interest in the person or object that experiences an action rather than the person or object that performs the action. In other words, the most important thing or person becomes the _____ of the sentence. If we want to say who or what performs the action while using the passive voice, we use the preposition ____. The passive voice in English is composed of two elements: the appropriate form of the verb '_____' + past participle of the main _____. **3. Переведите предложения. Выделите конструкции с пассивным залогом, определите временную форму глагола-сказуемого.** I'm Michael Kohl and I was hired by Volkswagen in the design department. We work on the exterior design for new cars, and many modern car models have been designedrecently by our department. My apprenticeship with VW was being done during three years after leaving school. I thought it would be a good company to work for. So, it was decided to send the letter of application to VW and to apply for the training scheme. I was one of 6 000 applicants for only 600 places. After a lot of tests and interviews the best candidateswere accepted. Then I went to a special college to study design and modelling. When I got my qualification, I was given a permanent job at VW. **4. Раскройтескобки, употребляяглаголыв Present, Past или Future Simple Passive.** 1. Bread (to eat) every day. 2. The letter (to receive) yesterday. 3. Nick (to send) to Moscow next week. 4. I (to ask) at the lesson yesterday. 5. I (to give) a very interest-ing book at the library last Friday. **5. Раскройте скобки, выбирая требующуюся форму глагола.** 1. The porter will (bring, be brought) your luggage to your room. 2. Your luggage will (bring, be brought) up in the lift. 3. You may (leave, be left) your hat and coat in the cloak-room downstairs. 4. They can (leave, be left) the key with the clerk downstairs. 5. From the station they will (take, be taken) straight to the hotel. **6.Поставьте выделенные глаголы в PassiveVoice, внеся необходимые изменения в предложения.** 1. She took a long time to write the composi¬tion, but at last she wrote it. 2. Don't put the cup there: somebody will break it. 3. Why weren't you at the birthday party? – They didn't invite me. 4. We met many difficulties, but all the same we finished the work in time. 5. We shall leave you behind if you are not quick.
УК-5.2	Владеет навыками толерантного поведения при выполнении	**1. Complete the diagram with the following words.** Accepts attend apply advertisement candidates invites offers 1. Employer posts a job _____ on a website or in a newspaper 2. Job-seekers _____ for the post

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	профессиональных задач	3. The employer selects suitable _____ 4. The employer _____ the selected candidates for interview 5. Candidates _____ their interview 6. The employer _____ the job to the best candidate 7. The candidate _____ or declines the offer **2. Составьтепредложения.** 1) would be – by - work – at 9.00 – John - started 2) to deal with – he – not – would have - customers 3) job – not - his –paid - very well - is 4) a customer service representative – developed – I – as - good communication skills - while working 5) experienced - to hire - many companies – want - workers **3.Five people describe their jobs. Match the jobs (1-5) with the descriptions (a-e) and put the words in brackets into the correct grammatical form.** 1 accountant 2 postwoman 3 flight attendant 4 software developer 5 teacher a. “Obviously, my work involves ….. (travel) a lot. It can be quite physically ….. (demand), but I enjoy ….. (deal) with customers, except when they become violent. This doesn’t happen often, but it can be very dangerous for us and the other passengers”. b. “I love my job. It’s very ….. (stimulate) and not at all ….. (repeat): no two days are the same. The children are fine: you see them learn and develop. The parents can be of a problem”. c. “I was good at maths at school and I like ….. (work) with figures. But my job is much less ….. (bore) and routine than people think. The work ….. (involve) a lot of human contact and teamwork, working with other managers”. d. “You’ve got to think in a very logical way. There is a lot of teamwork between the developers. The work can be mentally ….. (tire), but it’s very satisfying to write a program that works”. e. “Of course, it involves getting up quite early in the morning. But I like ….. (be) out in the open air. And you get a lot of exercise. I walk two or three miles every day”. **4.Who does each of the following activities? Write E for employer and J for job-seeker.** Search job ads post a job ad hire Scan resumes supply resumes fulfill jobs Recruit staff use career management service Join a firm **5. Соотнесите.** 1) to reject an offer или to turn down an offer a) удовлетворение от выполняемой работы b) руководить собственным делом

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		2) a dead-end job 3)a heavy workload 4) job satisfaction 5) to run your own business 6) to be/get stuck in a rut 7)working conditions 8) to meet a deadline 9) a skilled worker 10) holiday entitlement c) увязнуть в рутине e) условия труда f) завершить работу в установленные сроки g) большой объем работы h) опытный рабочий i)бесперспективнаяработа j)отпуск k)отказаться от предложения
УК-6 – Способен определять и реализовывать приоритеты собственной деятельности и способы ее совершенствования на основе самооценки		
Методология и методы научного исследования		
УК-6.1	Определяет образовательные потребности и способы совершенствования собственной (в том числе профессиональной) деятельности на основе самооценки	***Практические задания для проведения промежуточной аттестации:*** **Задание.** Разработка понятийного аппарата проблемы и поиск решения проблемы. В соответствии с алгоритмом разработать понятийный аппарат исследования. Шаг 1. Найти и зафиксировать толкования и области применения основного понятия. Шаг 2. Указать особенности области исследования. Шаг 3. Раскрыть основное понятие, опираясь на особенности области исследования. Шаг 4. Если искомого понятия нет, следует разбить его на два компонента: ближайшее родовое понятие и понятие-уточнение. Далее принять основным понятием ближайшее родовое понятие и повторить для него шаги 1-3. Шаг 5. Найти и зафиксировать толкования и области применения понятия-уточнения. Шаг 6. Синтезировать основное понятие исследования, опираясь на свойства родового понятия и понятия- уточнения. Шаг 7. В том случае, если для ближайшего родового понятия нет определения, выделить родовую философскую категорию и повторить шаги 4-6. ***Теоретические вопросы для проведения промежуточной аттестации:*** 1 Эвристические методы и приемы анализа. Методика Форсайт-исследований. 2 Методы экспертных оценок: Дельфийский метод и метод парных корреляций. 3.Особенности формирования экспертных групп для проведения научных исследований. 4 Методы теории игр. 5 Методы теории массового обслуживания. 6 Методы анализа ликвидности и платежеспособности организации. 7 Методы анализа финансовой устойчивости организации. 8 Инструментарий и механизм финансового анализа. 9 Методы статистики в экономических исследованиях: корреляционно-регрессионный анализ. 10 Методы статистики в экономических исследованиях: дисперсионный анализ. 11 Методы статистики в экономических исследованиях: статистика Дарбина-Уотсона.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		12 Методы статистики в экономических исследованиях: кластерный анализ. ***Тестовые задания:*** 1 **Какой из перечисленных методов оценки дает представление о наиболее критических факторах проекта**: а) вероятностный метод; б) метод построения дерева решений; в) метод сценариев; г) анализ чувствительности. 2 **Какой из перечисленных методов исследования представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты**: а) вероятностный метод; б) метод построения дерева решений; в) метод сценариев; г) анализ чувствительности. 3 Укажите основные методы оценки вероятности событий: а) статистический метод; б) аналитический метод; в) экспертный метод; г) все ответы верны. 4 Укажите тип детерминированной модели $y = \sum_{i=1}^{n} x_i = x_1 + x_2 + ... + x_n$: а) аддитивная; б) мультипликативная; в) кратная (смешанная); г) нет правильного ответа. 5 Укажите тип детерминированной модели $y = \prod_{i=1}^{n} x_i = x_1 \cdot x_2 \cdot ... \cdot x_n$: а) аддитивная; б) мультипликативная; в) кратная (смешанная); г) нет правильного ответа. 6 Укажите тип детерминированной модели $y = \sum_{i=1}^{n} x_i \Big/ \sum_{j=1}^{m} x_j$: а) аддитивная;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		б) мультипликативная; в) кратная (смешанная); г) нет правильного ответа. 7 Укажите методы факторного анализа рисковых ситуаций: а) метод цепных подстановок; б) метод абсолютных разниц; в) метод относительных разниу; г) все ответы верны. 8 Укажите коэффициенты, характеризующие изменения относительного показателя за определенный период: а) коэффициенты динамики; б) коэффициенты структуры; в) коэффициенты эффективности; г) коэффициенты координации. 9 Укажите коэффициенты, которые исчисляются как соотношение части и целого по однородной группе изучаемых явлений и процессов: а) коэффициенты динамики; б) коэффициенты структуры; в) коэффициенты эффективности; г) коэффициенты координации. 10 Укажите коэффициенты, которые исчисляются как соотношение полученного результат деятельности и затрат: а) коэффициенты динамики; б) коэффициенты структуры; в) коэффициенты эффективности; г) коэффициенты координации. 11 Укажите название средней величины, исчисляемой по формуле $\bar{x} = \sum_{i=1}^{n} x_i \Big/ n$: а) простая средняя арифметическая; б) средняя геометрическая; в) средняя хронологическая; г) простая средняя гармоническая. 12 Укажите название средней величины, исчисляемой по формуле $\bar{x} = \left(\frac{x_1}{2} + x_2 + \ldots + \frac{x_n}{2}\right) \Big/ (n-1)$: а) простая средняя арифметическая; б) средняя геометрическая; в) средняя хронологическая;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		г) простая средняя гармоническая. 13 Укажите метод многомерного статистического анализа, предназначенный для группировки совокупности данных, элементы которой характеризуются многими признаками: а) корреляционный анализ; б) дисперсионный анализ; в) кластерный анализ; г) регрессионный анализ. 14 Укажите наименование статистического метода, позволяющего подтвердить или опровергнуть гипотезу о том, что две выборки данных относятся к одной генеральной совокупности: а) корреляционный анализ; б) дисперсионный анализ; в) кластерный анализ; г) регрессионный анализ. 15 Какой показатель ликвидности характеризуется отношением наиболее ликвидных активов к наиболее срочным и краткосрочным обязательствам компании: а) коэффициент абсолютной ликвидности; б) коэффициент критической ликвидности (промежуточный коэффициент покрытия); в) коэффициент текущей ликвидности (коэффициент покрытия); г) коэффициент общей платежеспособности; 16 Какой показатель ликвидности характеризуется отношением наиболее ликвидных и быстрореализуемых активов к наиболее срочным и краткосрочным обязательствам компании: а) коэффициент абсолютной ликвидности; б) коэффициент критической ликвидности (промежуточный коэффициент покрытия); в) коэффициент текущей ликвидности (коэффициент покрытия); г) коэффициент общей платежеспособности; 17 Какой показатель ликвидности характеризуется отношением наиболее ликвидных, быстрореализуемых и медленно реализуемых активов к наиболее срочным и краткосрочным обязательствам компании: а) коэффициент абсолютной ликвидности; б) коэффициент критической ликвидности (промежуточный коэффициент покрытия); в) коэффициент текущей ликвидности (коэффициент покрытия); г) коэффициент общей платежеспособности; 18 Какой показатель ликвидности характеризуется отношением наиболее срочных, краткосрочных и долгосрочных обязательств к активам компании: а) коэффициент абсолютной ликвидности; б) коэффициент критической ликвидности (промежуточный коэффициент покрытия); в) коэффициент текущей ликвидности (коэффициент покрытия); г) коэффициент общей платежеспособности;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		20 Что понимается под оборотным капиталом компании: а) разница между текущими активами и краткосрочными обязательствами компании; б) оборотные активы компании; в) оборотные средства компании; г) разница между итогом раздела баланса компании «Капитал и резервы» и всеми ее обязательствами. 21 Укажите основные направления оценки финансовой устойчивости современной компании: а) по соотношению собственного и заемного капитала; б) по функциональному признаку; в) по соотношению финансовых и нефинансовых активов; г) верны все ответы. 22 Какой показатель финансовой устойчивости компании рассчитывается как соотношение ее собственного капитала и активов: а) коэффициент концентрации собственного капитала; б) коэффициент финансовой зависимости; в) коэффициент устойчивого финансирования; г) коэффициент финансовой независимости капитализированных источников. 23 Какой показатель финансовой устойчивости компании рассчитывается как соотношение ее активов и собственного капитала: а) коэффициент концентрации собственного капитала; б) коэффициент финансовой зависимости; в) коэффициент устойчивого финансирования; г) коэффициент финансовой независимости. **Задание № 4.** На основе использования современных методов финансового анализа оценить уровень риска по показателям ликвидности и платежеспособности промышленной компании по следующим критериям: - коэффициент абсолютной ликвидности; - коэффициент критической ликвидности; - коэффициент текущей ликвидности; - коэффициент общей платежеспособности; - величина оборотного капитала; - показатель маневренности собственных оборотных средств предприятия; - показатель доли собственных оборотных средств в покрытии производственных запасов предприятия. Исходная информация для расчетов представлена в таблице 1 и характеризуют состояние активов и пассивов компании по состоянию на конец 2016 и 2017 гг. (по данным бухгалтерской отчетности компании). Проанализировать полученные результаты, сделать необходимые выводы об уровне риска, ликвидности и платежеспособности компании. Выявить изменения в финансовом состоянии промышленной компании, произошедшие в течение календарного 2017 года. Разработать мероприятия по управлению риском и оптимизации финансового состояния компании. Таблица 1 – Исходные данные для идентификации, оценки и анализа рисков промышленной компании по состоянию на

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		конец 2016 и 2017 гг., млн. руб.

Наименование показателей	Вариант - 1		Вариант - 2	
	2016	2017	2016	2017
ВНЕОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ				
1. Нематериальные активы	28	704	171	263
2. Основные средства	32108	39430	38022	40537
3. Незавершенное строительство	221	176	103	83
4. Доходные вложения в материальные ценности	398	542	102	146
5. Долгосрочные финансовые вложения	610	388	404	363
6. Прочие внеоборотные активы	49	0	34	72
Итого по разделу I	33668	41320	38836	41464
в т.ч. неходовые материальные ценности	31	33	28	25
ОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ				
1. Запасы:	21773	23078	23078	26006
- сырье, материалы и др.	19383	20046	19023	21516
- затраты в незавершенном производстве	314	368	892	917
- готовая продукция и товары для продажи				
- товары отгруженные	2029	2618	3100	3499
- расходы будущих периодов	15	12	32	34
- прочие запасы	266	286	274	337
2. НДС по приобретенным ценностям	3179	3259	3620	3872
3. Дебиторская задолженность (платежи более чем через 12 месяцев после отчетной даты)	1 055	843	522	501
в т.ч. покупатели и заказчики	–	–	–	–
4. Дебиторская задолженность (платежи в течение 12 месяцев после отчетной даты)	16377	18400	12484	14501
в т.ч. покупатели и заказчики	4410	4687	33 2	2607
5. Авансы выданные	883	946	760	502
6. Прочие дебиторы	1063	1256	1022	1053
7. Краткосрочные финансовые вложения	4082	3892	1855	1925
8. Денежные средства	166	150	364	387
9. Прочие оборотные активы	–	–	–	–

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*				
		Итого по разделу II	48578	51824	43705	4 747
		Итого активов	82246	93144	82541	90211
		КАПИТАЛ И РЕЗЕРВЫ				
		1. Уставный капитал	21750	21750	25550	25550
		2. Добавочный капитал	983	1050	1222	1309
		3. Резервный капитал	5834	5834	6699	6753
		4. Нераспределенная прибыль	2866	7025	6975	10336
		Итого по разделу III	31433	35659	40446	43948
		ДОЛГОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА				
		1. Займы и кредиты	14255	16810	10093	11092
		2. Прочие долгосрочные обязательства	303	450	352	288
		Итого по разделу IV	14558	17260	10445	11380
		КРАТКОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА				
		1. Займы и кредиты	21734	25629	18840	21045
		2. Кредиторская задолженность:	12937	12740	11187	12528
		- поставщики и подрядчики - задолженность перед персоналом - задолженность перед государственными внебюджетными фондами - задолженность по налогам и сборам	11711 389 109 728	11375 376 102 887	10286 333 93 475	11509 377 105 537
		3. Авансы полученные	772	990	780	593
		4. Прочие кредиторы				
		5. Задолженность перед учредителями по выплате доходов	–	–	–	–
		6. Доходы будущих периодов	812	866	843	717
		7. Резервы предстоящих расходов	–	–	–	–
		8. Прочие краткосрочные обязательства	–	–	–	–
		Итого по разделу V	36255	40225	31650	34883
		Итого пассивов	82246	93144	82541	90211
		Задание № 5. На основе использования современных методов финансового анализа оценить уровень риска и финансовой				

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		устойчивости промышленной компании по следующим критериям и показателям: - коэффициент концентрации собственного капитала; - коэффициент концентрации заемного капитала; - коэффициент финансовой зависимости; - коэффициент текущей задолженности; - коэффициент устойчивого финансирования; - коэффициент финансовой независимости капитализированных источников; - коэффициент финансовой зависимости капитализированных источников; - коэффициент покрытия долгов собственным капиталом; - коэффициент финансового левериджа (коэффициент финансового риска). Исходная информация для расчетов представлена в таблице 1 и характеризуют состояние активов и пассивов компании по состоянию на конец 2016 и 2017 гг. (по данным бухгалтерской отчетности компании). Проанализировать полученные результаты, сделать необходимые выводы об уровне риска и финансовой устойчивости компании. Выявить изменения в финансовом состоянии промышленной компании, произошедшие в течение календарного 2017 года. Разработать мероприятия по оптимизации уровня риска и финансового состояния компании
УК-6.2	Выбирает и реализует с использованием инструментов непрерывного образования возможности развития профессиональных компетенций и социальных навыков	***Практические задания для проведения промежуточной аттестации:*** На сайте vak.gov.ru найти паспорта научных специальностей; отобрать те, которые относятся к сфере ИКТ. Распределить шифры научных специальностей между студентами группы. Описать области научного знания в сфере ИКТ. На том же сайте воспользоваться системой поиска диссертаций, вывести список за 3 года по заданному шифру научной специальности; сделать вывод о тематике научных исследований. На сайте научного журнала (по вариантам) изучить тематику статей за 3 последних года, сделать обзор направлений научных исследований. Подготовить отчет в соответствии с требованиями. Выбрать тему исследовательского проекта, подобрать научные источники для проработки направления исследований. Изучить рекомендуемые учебники и пособия, определить последовать этапов выполнения научно-исследовательской работы. Ответить на примерные вопросы для самоконтроля. 1) перечислите этапы исследовательской деятельности ; 2) что такое научный замысел; 3) научная новизна; 4) научная значимость исследования; 5) что такое метод и инструментарий исследования; 6) классификация методов исследования; 7) характеристика конкретных научных методов и инструментов исследования; 8) этапы выполнения научно-исследовательской работы. Определить последовательность работы над исследовательским проектом. Информационные ресурсы и технологии поддержки научного исследования

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Изучить рекомендуемые учебники и пособия. Дать классификацию информационных ресурсов в сети Интернет в зависимости от их функций (библиотечные, открытые наборы экспериментальных данных, серверы научных публикаций и т.п.). Определить функционал существующих систем поддержки научных исследований. Ответить на примерные вопросы для самоконтроля: 1) системы поддержки научных исследований; 2) российские электронные библиотеки; 3) зарубежные электронные библиотеки; 4) порталы научной информации, посвященные исследованиям в сфере ИКТ (машинное обучение, нейронные сети, теория алгоритмов и т.п.). Подобрать информационные ресурсы и сервисы для своего исследовательского проекта. ***Тестовые задания:*** 1. К какому типу исследования относится эксперимент. 2. Укажите обязательные характеристики эксперимента как метода научного исследования: а) наличие специальной лаборатории б) возможность повторения в) наличие проверяемой гипотезы г) специально созданные и контролируемые условия д) использование приборов 3. Соотнесите описание типа эксперимента и его название 1) активное изменение структуры и функций изучаемого объекта, преднамеренное создание условий, которые должны способствовать появлению его новых качеств — а) поисковый 2) эксперименты, результаты которых однозначно свидетельствуют в пользу одной теоретической системы и опровергают альтернативную ей систему — б) констатирующий 3) начальная стадия в серии экспериментальных исследований; проводится в тех ситуациях, когда недостаточно известен комплекс факторов, влияющих на изучаемый объект — в) преобразующий 4) решение задачи обеспечения контроля над изучаемым объектом, управления объектом с помощью воздействующих факторов с одновременным изучением изменений его состояния в зависимости от воздействия — г) решающие 5) проверка какого-либо исходного предположения; целью является фиксация наличия или отсутствия определенных свойств, отношений, эффектов, состояний и т.п. — д) контролирующий 4. Как называется эксперимент, осуществляемый в целях внедрения новых форм социальной организации и оптимизации

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		управления: а) управленческий; б) общественный; в) социальный. 5. Как называется эксперимент, устанавливающий наличие или отсутствие предлагаемых теорией явлений? 6. По характеру внешних воздействий на объект исследования эксперименты бывают: а) мысленными; б) социальными; в) энергетическими; г) вещественными; д) информационными. 7. Не существует единого шаблона или схемы, с помощью которых можно было бы строить эксперимент для решения любой проблемы в любой отрасли экспериментальных наук: а) верно; б) неверно. 8. Соотнесите требование к результатам эксперимента и его описание 1) эффективность оценок — а) При увеличении числа наблюдений оценка параметра должна сместиться к истинному значению 2) несмещенность оценок — б) Минимальность дисперсии отклонения относительно неизвестного параметра 3) состоятельность оценок — в) Отсутствие систематических ошибок в процессе вычисления параметров 9. Как называется измеримая переменная величина, принимающая в некоторый момент некоторое определенное значение и соответствующая одному из возможных способов воздействия на объект исследования? 10. Требования к системе факторов эксперимента: а) несовместимость факторов; б) отсутствие корреляции; в) наличие корреляции; г) совместимость; д) полнота. 11. Как называется степень совпадения показаний измерительного прибора с истинным значением измеряемой величины: а) точность; б) чувствительность; в) стабильность; г) погрешность. 12 Как называется наименьшее значение измеренной величины, вызывающее изменение показания прибора, которое можно

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		зафиксировать: а) цена деления; б) класс точности; в) чувствительность; г) порог чувствительности. ***Индивидуальные домашние задания (ИДЗ):*** 1. Разработайте программу эксперимента для своего исследования. 2. Проведите эксперимент в соответствии с разработанной программой.
УК-6.3	Выстраивает гибкую профессиональную траекторию с учетом накопленного опыта профессиональной деятельности, динамично изменяющихся требований рынка труда и стратегии личного развития	***Теоретические вопросы для проведения промежуточной аттестации:*** 1 Моделирование как метод научных исследований: экономико-математические модели, аддитивные, мультипликативные и кратные модели. 2 Регрессионно-корреляционный анализ и аппроксимация стохастических зависимостей случайных величин в научном исследовании. 3 Адекватность, детерминация и автокорреляция зависимостей, дисперсионный анализ в научном исследовании. 4 Детальная и официальная апробация результатов научных исследований. 5 Организационные основы современных научных исследований. 6 Публикации научных исследований: периодические издания, сборники трудов, монографии. 7 Официальная апробация результатов научных исследований: конференции, симпозиумы, семинары. 8 Детальная апробация результатов научных исследований на примере конкретного экономического объекта. 8 Научно-исследовательская деятельность: научные проблемы, научные программы, гранты. 9 Информационно-коммуникационные технологии в современной научно-исследовательской деятельности: системы подготовки, сбора, обработки и анализа данных. ***Тестовые задания:*** 1 Тип экономико-математической модели, в которой связи между факторами выражены знаками сложения (вычитания): а) аддитивная модель; б) мультипликативная модель; в) кратная модель; г) нет правильного ответа. 2 Тип экономико-математической модели, в которой связи между факторами выражены знаками умножения (деления): а) аддитивная модель; б) мультипликативная модель; в) кратная модель; г) нет правильного ответа. 3 Тип экономико-математической модели, в которой связи между факторами выражены как знаками сложения (вычитания), так и знаками умножения (деления):

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		а) аддитивная модель; б) мультипликативная модель; в) кратная модель; г) нет правильного ответа. 4 Укажите тип апробации результатов научных исследований, проводимой в конкретных условиях предприятия, организации, учреждения: а) официальная апробация; б) детальная апробация; в) оба ответа верны; г) нет правильного ответа. 5 Укажите тип апробации результатов научных исследований, проводимой в условиях научно-теоретического семинара: а) официальная апробация; б) детальная апробация; в) оба ответа верны; г) нет правильного ответа. 6 Укажите тип апробации результатов научных исследований, проводимой в условиях научной или научно-практической конференции: а) официальная апробация; б) детальная апробация; в) оба ответа верны; г) нет правильного ответа. 7 Укажите тип апробации результатов научных исследований, проводимой в условиях или научно-технической выставки: а) официальная апробация; б) детальная апробация; в) оба ответа верны; г) нет правильного ответа. 8 Укажите параметры официального сообщения на научной конференции: а) гипотеза; б) критерий; в) ограничения; г) модель; д) механизм; е) инструментарий; ж) все ответы верны. ***Примерные индивидуальные домашние задания (ИДЗ):*** 1 Система научных исследований в экономике.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		2 Методы и методики научных исследований в экономике. 3 Моделирование как метод научных исследований: формализация модели и проверка на адекватность. 4 Методика регрессионно-корреляционного анализа и порядок аппроксимации стохастических зависимостей. 5 Сущность и содержание дисперсионного анализа, детерминация и автокорреляция зависимостей. 6 Публикационные параметры научных исследований: Российский индекс научного цитирования, системы рецензирования ВАК РФ, Scopus, Web of Science. 7 Публикационная активность исследователя: индекс Хирша. 8 Публикационные параметры научных изданий: Impact-фактор. 9 Структура научной статьи в периодических изданиях: актуальность темы работы, объект, предмет, цели и задачи, методика и методология, анализ результатов. 10 Организация научно-исследовательских разработок в рамках научного гранта. 11 Возможности современных IT-технологий в системе научных исследований и официальном представлении их результатов.
ОБЩЕПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ		
ОПК-1 – Способен применять знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач		
Макроэкономика (продвинутый уровень)		
ОПК-1.1	Использует фундаментальные экономические знания (на продвинутом уровне) при решении практических и (или) исследовательских задач в профессиональной области	***Перечень теоретических вопросов к зачету:*** 1. Методические подходы к процедурам подготовки и принятия решений 2. Основные тренды макроэкономического развития: устойчивое развития 3. Основные тренды макроэкономического развития: цифровая экономика 4. Основные тренды макроэкономического развития: гуманизация 5. Основные тренды макроэкономического развития: глобализация 6. Основные тренды макроэкономического развития: интеграция 7. Антиинфляционная политика: порядок и методы проведения 8. Стабилизационная политика в условиях стагфляции. 9. Два метода определения равновесия в кейнсианской теории: «совокупные расходы – объем производства» и «изъятия – инъекции». Фискальная политика государства (дискреционная и недискреционная 10. Стимулирующая и сдерживающая фискальная политика: политика дефицита, избытка и сбалансированного бюджета. Мультипликатор сбалансированного бюджета. 11. Способы финансирования дефицита бюджета и способы избавления от излишков. Государственные займы и государственный долг. 12. Оценка эффективности фискальной политики с точки зрения монетаризма и кейнсианской теории. 13. Оценка эффективности кредитно-денежной политики с точки зрения монетаризма и кейнсианской теории. Монетарное правило. 14. Механизм и причины циклического развития экономики. Антициклическая политика.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		15. Условия роста в современной российской экономике. 16. Особенности переходной экономики России. Содержание рыночных реформ. Структурная перестройка экономики. Современная социально-экономическая политика. 17. Монетаристское объяснение инфляции. 18. Устойчивость макроэкономического равновесия: классический подход. 19. Кейнсианский подход к проблеме макроэкономического равновесия. 20. Классический и кейнсианский подход к проблеме безработицы. 21. Теории экономического роста 22. Экономические последствия инфляции 23. Причины макроэкономической нестабильности 24. Система национальных счетов 25. Основные макроэкономические показатели, порядок из расчета ***Практические задания*** 1. В экономике страны естественный уровень безработицы равен 6,5%, а фактический – 10%. Потенциальный ВВП составляет 4000 млрд. долл., коэффициент Оукена – 2,7. Какую политику должно проводить правительство для стабилизации экономики (рассмотрите все возможные инструменты), если известно, что предельная склонность к потреблению равна 0,75. 2. Депозиты банка составляют 100 млрд. долл. Фактические резервы банка – 30 млрд. долл. Норма обязательных резервов равна 12%. Каковы кредитные возможности банка? Какова величина избыточных резервов? Каковы возможности всей банковской системы увеличить дополнительно предложение денег? 3. В результате финансового кризиса экономика страны в течение двух лет находилась в состоянии рецессии: реальный ВВП в первый год сократился на 8%, а во второй - на 6%. Сколько потребуется лет, чтобы экономика смогла вернуться к докризисному объему реального ВВП, если она в ближайшие годы будет расти согласно пессимистическому прогнозу с темпом 2% в год, а согласно оптимистическому прогнозу - с темпом 5% в год? 4. Номинальная доходность облигаций в текущем году составляет 25%. Базисный ИПЦ в текущем году равен 180%, а в предыдущем - 160%. Какова реальная доходность облигации? 5. Номинальный курс рубля к евро вырос за год с 40 до 45 руб./евро, темп инфляции за год в России составил 12%, а в еврозоне - 3%. Определите темп прироста реального курса рубля к евро. Какая из двух валют обесценилась в номинальном выражении, какая - в реальном? 6. Центральный банк покупает на отрытом рынке государственные бумаги стоимостью 1 млн. ден. ед. Все вырученные деньги поступают на счет продавца в банке. Покажите, каким будет непосредственное влияние этой операции на объем денежной массы и какие дальнейшие изменения будут иметь место в этом случае? Что произошло бы в случае, если все деньги продавец ценных бумаг получил наличными? 7. Экономика страны характеризуется следующими данными: ес тественный уровень безработицы равен 5%; фактический уровень безработицы - 6,5%. Правительство поставило задачу обеспечить полную занятость. Для этого предпринимаются меры, стимулирующие рост реального ВВП. По прогнозам, в следующем году снижение фактического ВВП замедлится, в результате чего отставание фактического ВВП от потенциального составит 1,5%. На сколько (в %) изменится в следующем году отставание факти

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		ческого объема производства от ВВП, соответствующего полной занятости (коэффициент чувствительности ВВП к динамике циклической безработицы равен 2)? **Вопросы** 1. В чем различие кейнсианского и неоклассического подходов к вопросу о роли совокупного спроса в его взаимодействии с совокупным предложением? 2. Чем характеризуются неоклассический и кейнсианский подходы к роли денег? Есть ли в этих различиях практический смысл 3. Укажите на сходство и различия кейнсианской и монетаристской моделей регулирования. Какая модель, на ваш взгляд, более подходит к российской экономике? Как можно объяснить утверждение неоклассиков о «нейтральности денег» в экономике? Что следует понимать под «классической дихотомией»? ***Задания :*** **1.** Раскройте основное содержание кейнсианской модели государственного регулирования экономики. При каких условиях эта модель может дать наибольший эффект? Приведите примеры. **2.** В чем своеобразие монетаристской модели регулирования экономики? Что ее отличает от других моделей и что объединяет? В чем проявляются «дефекты» государства? Какие противоречия обнаружила практика государственного регулирования экономики? Приведите примеры **3.** Приведите данные о безработице в регионе, в котором вы живете (за последние год-два). Сравните их с данными по России в целом. Почему безработица является макроэкономической проблемой? **4.** Приведите данные об инфляции (по ИПЦ) в регионе, в котором вы живете. Сравните их с данными по России в целом. Каковы, на ваш взгляд, причины расхождений? **5.** Перечислите возможные последствия девальвации национальной валюты как способа решения проблемы платежного баланса. **6.** Опишите, какое влияние на темпы инфляции и объемы производства окажут следующие события (укажите тип шока - спроса или предложения, постоянный или временный, номинальный или реальный, позитивный или негативный - и определите первую реакцию экономики на шок): а) правительство увеличивает реальные размеры пенсий; б) из-за бума на фондовом рынке богатство частного сектора значительно увеличивается; в) в результате благоприятной погоды собран урожай больше обычного; г) государство в следующем году увеличивает регулируемые цены и тарифы **7.** На каких международных рынках конкуренция более совершенна - на рынках конечных или сырьевых товаров? Раскройте особенности ценообразования на этих рынках. **8.** Объясните, как внешняя торговля влияет на производство и потребление населения отдельных стран. В каком случае население выигрывает от внешней торговли, а в каком - проигрывает? Сформулируйте уравнения взаимосвязей рынков капитала, труда, благ и денег в динамической модели общего макроэкономического обмена. Каковы условия существования и устойчивости равновесий в этой модели? В чем различия в формулировках модели макроэкономического обмена со свойствами нейтральности и не-нейтральности денег?

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td>ОПК-1.2</td><td>Выбирает наиболее подходящую теоретическую модель для решения (на продвинутом уровне) практических или исследовательских задач экономической направленности и обосновывает свой выбор</td><td>
Задания:
1. Подготовьте информацию об основных экономических показателях РФ за 2017-2020 гг. Выберите показатели, создайте электронные таблицы, используйте для лучшей визуализации диаграммы и графики – создайте модель для решения. Сделайте выводы!!

Используйте информацию из официальных источников:

• Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики https://rosstat.gov.ru/
• Официальный сайт Министерства финансов РФ https://minfin.gov.ru/
• Официальный сайт центрального банка РФ https://www.cbr.ru/
• Официальный сайт Федеральной налоговой службы https://www.nalog.ru/

2. Исследуйте цели устойчивого развития (17 целей). Опишите возможные действия (по одному) со стороны государства, бизнеса, человека.
<table>
<tr><td rowspan="2">Цель</td><td rowspan="2">Картинка</td><td colspan="3">Действия для достижения</td></tr>
<tr><td>Государство</td><td>Бизнес</td><td>Человек</td></tr>
<tr><td>1</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>2</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table>
https://www.un.org/sustainabledevelopment/ru/sustainable-development-goals/
Задание:
Опишите макроэкономический тренд «Глобализация» - разработайте модель описания. Сделайте презентацию в PowerPoint: понятие, текущее проявление, влияние на бизнес и человека.
</td></tr>
<tr><td>ОПК-1.3</td><td>Составляет план и осуществляет исследования реальной экономической ситуации (на продвинутом уровне) с применением методов фундаментальной экономической науки</td><td>
Задание:
Составьте план исследования ситуации с проявлением макроэкономического тренда:
Вариант 1 устойчивое развитие
Вариант 2 гуманизация
Вариант 3 цифровая экономика
Оформите с использованием ПО.
</td></tr>
<tr><td colspan="3">Безопасность экономических систем</td></tr>
<tr><td>ОПК-1.1</td><td>Использует фундаментальные экономические знания</td><td>
Перечень теоретических вопросов к итоговой аттестации
1. Современный экономический потенциал России.
2. Оценка социально-экономической ситуации России.
</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	(на продвинутом уровне) при решении практических и (или) исследовательских задач в профессиональной области	3. Типология коррупциогенных факторов и критерии их оценки. 4. Национальная безопасность государства. 5. Экономическая составляющая безопасности государства. 6. Влияние природных условий и географического положения на экономическую безопасность. 7. Пороговые значения и индикаторы, характеризующие экономическую безопасность государства. 8. Роль экономической безопасности в системе национальных интересов России. 9. Обеспечение экономической безопасности России. 10.Критерии и параметры состояния экономики, отвечающие требованиям экономической безопасности России. 11. Внутренние и внешние угрозы национальной безопасности России. 12. Конкурентно способность национальной экономики и ее отраслей. 13. Криминализация экономики как одна из угроз экономической безопасности. 14. Теневой сектор экономики России, коррупция. Бюрократия и власть в новой России. 15. Формирование правосознания и антикоррупционного поведения в обществе. 16. Упорядочение правового обеспечения государственного управления. 17. Основные виды правонарушений коррупционного характера в системах государственной и муниципальной служб. 18. Эффективность конкурсных процедур по поводу использования государственного и муниципального имущества, средств соответствующих бюджетов. 19 . Коррупционные правонарушения при осуществлении закупок, поставок, работ и услуг для государственных и муниципальных нужд. 20. Рейдерство как типичное коррупционное проявление. 21. Коррупционные риски в процессе подготовки, принятия и реализации законов и иных нормативных правовых актов. 22. Конфликт интересов на государственной и муниципальной службе. Порядок его предотвращения и урегулирования. 23. Сущность экономической безопасности. Критерий экономической безопасности. 24. Система показателей – индикаторов экономической безопасности. Определение пороговых значений в этой области. 25. Система государственных закупок. 26. Механизм обеспечения экономической безопасности. 27. Классификация угроз экономической безопасности. Ключевые экономические угрозы. 28. Состояние в современной России технологического и кадрового потенциала. 29. Определение приоритетных сфер для инвестирования государством с учетом экономической безопасности. Механизм реализации приоритетов. 30. Федеральная и региональная поддержка инвестиций и инновационного процесса. Риски инвестиционных и промышленных проектов. Гарантии частным инвестициям. 31. Механизмы обеспечения экономической безопасности банковских вкладов в развитых странах. 32. Основные виды экономической безопасности. Энергетическая и сырьевая безопасность. Внешняя экономическая безопасность. Промышленная безопасность. Продовольственная безопасность. 33. Пути нейтрализации и предотвращения экономической безопасности. 34. Безработица и повышение занятости.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		35. Потребительская корзина как основа расчета минимальной заработной платы. 36. Типология субъектов РФ и тенденции усиления межрегиональной дифференциации. 37. Экономическая безопасность регионов. 38. Оценка конкурентно способности регионов РФ. Государственная региональная политика. 39. Угроза экономической безопасности регионов. Критерии и пороговые значения характеризующие экономическую безопасность регионов. 40. Дифференциация заработной платы и уровня жизни по регионам. Задачи государственной региональной политики. 41. Оценка экономического потенциала регионов. Основы оптимального соотношения доходов федерального и региональных бюджетов. 42. Взаимоотношение регионов рецепиентов и регионов доноров. Механизм выравнивания финансово-экономических потенциалов регионов. 43.Система финансовой безопасности на предприятии. 44 Налоговый потенциал. Налог как фактор экономической безопасности. 45. Пределы открытости и закрытости национальной экономики России.
ОПК-1.2	Выбирает наиболее подходящую теоретическую модель для решения (на продвинутом уровне) практических или исследовательских задач экономической направленности и обосновывает свой выбор	**Вопрос: 1:** Что из перечисленного ниже определяется защищенностью жизненно важных и законных интересов предприятия от внешних и внутренних угроз в различных противоправных формах ? 1: Безопасность предприятия; 2: Конкурентоспособность предприятия; 3: Прибыль предприятия; 4: Уставной капитал предприятия; **Вопрос:2** Какой из перечисленных источников внешних угроз характеризуется нарушениями прав на промышленную собственность, подрыве репутации, дезорганизации производства и т.п.? 1: Неблагоприятная экономическая политика государства; 2: Недобросовестная конкуренция; 3: Кризисные явления в мировой экономике; **Вопрос:3** Какой из перечисленных уровней организации системы безопасности предприятия включает мероприятия по обеспечению безопасности хозяйствующего субъекта специфическими методами и средствами? 1: Административный уровень; 2: Оперативный уровень; 3: Технический уровень; 4: Режимно-пропускной уровень. **Вопрос:4**

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Какие из перечисленных факторов, угрожающих безопасности предприятия, являются внутренними ? Выберите из списка все, относящиеся к внутренним. 1: Преступные действия сотрудников фирмы; 2: Нарушение режима сохранности коммерческой тайны; 3: Нарушение порядка использования технических средств; 4: Несоблюдение правил приводящее к возникновению экстремальных ситуаций; 5: Действия структур, занимающихся добыванием экономической информации ; 6: Действия отдельных лиц или фирм, занимающихся промышленным шпионажем; 7: Мошеннические действия отдельных лиц; 8: Организованная преступность. **Вопрос:5** Какие из перечисленных факторов, угрожающих безопасности предприятия, являются внутренними? 1: Преступные действия сотрудников фирмы; 2: Нарушение режима сохранности коммерческой тайны; 3: Нарушение порядка использования технических средств; 4: Несоблюдение правил приводящее к возникновению экстремальных ситуаций; 5: Действия структур, занимающихся)1.6494(_)добыванием экономической информа- ции; 6: Действия отдельных лиц или фирм, занимающихся промышленным шпионажем; 7: Мошеннические действия отдельных лиц; 8: Организованная преступность; **Вопрос:6** Как принято рассматривать риск ? 1: Как вероятность наступления нежелательного события; 2: Как стоимостные показатели события в случае его наступления; 3: Как вероятность наступления нежелательного события и как стоимостные показатели события в случае его наступления. **Вопрос:7** Какой подход к управлению рисками пропущен в данном списке: - Избежание; - Передача; - ……. - Сокращение. **Вопрос:8** При какой разновидности краж, совершаемых персоналом, сотрудники пытаются представить фиктивные документы для оплаты или преувеличить израсходованную сумму ? 1: Покупки, совершаемые персоналом; 2: Завышение расходов;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		3: Кражи при удалении и переработке отходов; 4: Кражи при складских операциях. **Вопрос:9** Какую разновидность краж, совершаемых персоналом, можно предотвратить организовав должную охрану продукции в межпроизводственный период хранения ? 1: Покупки, совершаемые персоналом; 2: Завышение расходов; 3: Кражи при удалении и переработке отходов; **Вопрос: 10** Какая разновидность краж, совершаемых персоналом, может возникнуть при предоставлении сотрудникам возможности покупать производимые изделия по ценам с высокими скидками ? 1: Покупки, совершаемые персоналом; 2: Завышение расходов; 3: Кражи при удалении и переработке отходов; 4: Кражи при складских операциях; **Вопрос: 11** Для какой разновидности пропуска установлено время действия в течение 30 минут с момента выдачи до входа на объект и в течение 15 минут после отметки о времени ухода с территории объекта ? 1: Постоянный пропуск; 2: Временный пропуск; 3: Разовый пропуск; 4: Материальный пропуск. **Вопрос: 12** Как называется документ, дающий право на вывоз (ввоз) материальных ценностей с территории предприятия ? 1: Товарный чек; 2: Накладная; 3: Счет-фактура; 4: Приходный ордер; 5: Доверенность. **Вопрос: 13;** Какими из перечисленных способов можно проверить психологическое, физическое, профессиональное соответствие кандидата на работу ? 1: Тестирование; 2: Диспансеризация; 3: Анкетирование; 4: Чтение рекомендаций; 5: Испытательный срок;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Вопрос: 14 Какое из приведенных ниже мошенничеств, совершаемых с помощью компьютера, встречается наиболее часто ? 1: Несанкционированное изменение вводимых данных; 2: Несанкционированное изменение уже хранящейся информации; 3: Шантаж с использованием компьютерных данных. **Вопрос:15** Какому из приведенных ниже требований должен соответствовать компьютерный пароль ? 1: Обычное слово не короче 8-ми букв; 2: Набор букв и цифр не менее 5-ти символов; 3: Набор из не менее чем 8-ми цифр; 4: Набор букв и цифр не менее 8-ми символов. **Вопрос: 16** Как называется мероприятие, проводимое непосредственно перед отправкой колонны с грузом на маршрут и поясняющее порядок следования, порядок использования средств связи, меры по технике безопасности и т.п. ? **Вопрос: 17** ……ситуация - это положение, в котором возникает угроза жизни человека, его здоровью или имуществу. Введите пропущенное слово.
ОПК-1.3	Составляет план и осуществляет исследования реальной экономической ситуации (на продвинутом уровне) с применением методов фундаментальной экономической науки	***Задание для самостоятельной работы 1:*** По данным официальной статистики определите показатели экономической безопасности РФ за 2015-2020 гг. Сравните их с пороговыми значениями и сделайте выводы об уровне и угрозах экономической безопасности РФ в настоящее время. ***Задание для самостоятельной работы 2:*** Оцените состояние финансовой безопасности конкретного предприятия на основе данных его бухгалтерского учета. Дать оценку деятельности предприятия (фирмы) по обеспечению безопасности, сформулировать угрозы и пути повышения уровня экономической безопасности
Мировые валютные системы		
ОПК-1.1	Использует фундаментальные экономические знания (на продвинутом уровне) при решении практических и (или) исследовательских	*Перечень теоретических вопросов к зачету с оценкой:* 1. Сущность и этапы развития мировой валютной системы. 2. Основные задачи мировой валютной системы как регулятора международных расчетов. 3. Система Золотого стандарта и обеспечение стабильности мировой валютной системы. 4. Золотодевизный стандарт и решения Генуэзской конференции 1922 г. 5. Золотовалютный стандарт и решения Бреттон-Вудской конференции 1944 г. 6. Ямайская валютная система и вытеснение золота из международных расчетов.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	задач в профессиональной области	7. Специальные права заимствования как международный резервный актив и «плавающие» валютные курсы. 8. Формирование Европейской валютной системы и устранение валютно-курсовых рисков. ***Примерные творческие задания для зачета с оценкой:*** 1. Разновидности Золотого стандарта: Золотомонетный стандарт. 2. Разновидности Золотого стандарта: Золотослитковый стандарт. 3. Разновидности Золотого стандарта: Золотодевизный стандарт. 4. Золотой стандарт в России: Золотой червонец 1923 года. 5. Валютные блоки и этапы кризиса Генуэзской валютной системы. 6. Цели создания, принципы построения и фундаментальные причины кризиса Бреттон-Вудской валютной системы. 7. Принципы устройства и механизм действия Ямайской валютной системы. 8. Специальные права заимствования SDRs как инструмент мировой валютной системы. 9. Преимущества и проблемы функционирования Европейской валютной системы. 10.Мировая валютная система как международный регулятор расчетов по поддержанию экономического роста и внешнеторгового обмена. ***Направления исследований для зачета с оценкой:*** 1. Возможности криптовалюты и перспективы поливалютной системы. 2. Системные валютные риски на мировом финансовом рынке. 3. Валюта как специальное средство международных расчетов, валютный рынок и банковские операции на валютном рынке. 4. Мировая валютная система как форма организации международных валютных отношений, закрепляемая межгосударственными соглашениями. 5. Ликвидность международных валютно-финансовых рынков как характеристика конвертируемости валют. 6.Роль резервной валюты на мировом финансовом рынке
ОПК-1.2	Выбирает наиболее подходящую теоретическую модель для решения (на продвинутом уровне) практических или исследовательских задач экономической направленности и обосновывает свой выбор	***Перечень теоретических вопросов к зачету с оценкой:*** 1. Элементы мировой валютной системы: национальные и коллективные валютные единицы, международные ликвидные активы (золотовалютные резервы)механизм валютных паритетов и курсов. 2. Режим международных валютных рынков и рынков золота, ограничения и конвертируемость валют. 3. Институты регулирования мировой валютной системы: Международный валютный фонд и Международный банк реконструкции и развития. 4. Специальные права заимствования SDR как международные кредитно-расчетные средства стран-членов МВФ. 5. Валютно-финансовые кризисы: сущность и классификации. 6. Инструментарий исследования валютно-финансовых кризисов. 7. Причины, особенности проявления и последствия мировых валютных кризисов. ***Примерные творческие задания для зачета с оценкой:*** 1. Валютный курс как инструмент финансовой политики государства и валютные интервенции.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		2. Формирование и основные задачи Международного валютного фонда (МВФ). 3. Международный банк реконструкции и развития МБРР (Мировой банк) и кредитование экономического развития. 4. Структура Мирового (Всемирного) банка: Международная ассоциация развития; Международная финансовая корпорация, Многостороннее агентство по гарантированию инвестиций, Международный центр урегулирования инвестиционных споров. 5. Риски на мировом финансовом рынке: валютный риск. ***Направления исследований для зачета с оценкой:*** 1. Причины, особенности проявления и последствия мировых валютных кризисов. 2. Модели валютных кризисов: модель П. Кругмана. 3. Модели валютных кризисов: модель с фиксированным валютным курсом. 4. Модели валютных кризисов: модель спекулятивной атаки. 5. Модели валютных кризисов: модель с фактором уверенности. 6.Модели валютных кризисов: модель асимметрии информации.
ОПК-1.3	Составляет план и осуществляет исследования реальной экономической ситуации (на продвинутом уровне) с применением методов фундаментальной экономической науки	***Перечень теоретических вопросов к зачету с оценкой:*** 1. Сущность и этапы развития мировой валютной системы. 2. Основные задачи мировой валютной системы как регулятора международных расчетов.. 3. Система Золотого стандарта и обеспечение стабильности мировой валютной системы. 4. Золотодевизный стандарт и решения Генуэзской конференции 1922 г. 5. Золотовалютный стандарт и решения Бреттон-Вудской конференции 1944 г. 6. Ямайская валютная система и вытеснение золота из международных расчетов. 7. Специальные права заимствования как международный резервный актив и «плавающие» валютные курсы. 8. Формирование Европейской валютной системы и устранение валютно-курсовых рисков. 9. Элементы мировой валютной системы: национальные и коллективные валютные единицы, международные ликвидные активы (золотовалютные резервы)механизм валютных паритетов и курсов. 10. Режим международных валютных рынков и рынков золота, ограничения и конвертируемость валют. 11. Институты регулирования мировой валютной системы: Международный валютный фонд и Международный банк реконструкции и развития. 12. Специальные права заимствования SDR как международные кредитно-расчетные средства стран-членов МВФ. 13. Валютно-финансовые кризисы: сущность и классификации. 14. Инструментарий исследования валютно-финансовых кризисов. 15. Причины, особенности проявления и последствия мировых валютных кризисов. ***Примерные творческие задания для зачета с оценкой:*** 1. Разновидности Золотого стандарта: Золотомонетный стандарт. 2. Разновидности Золотого стандарта: Золотослитковый стандарт. 3. Разновидности Золотого стандарта: Золотодевизный стандарт. 4. Золотой стандарт в России: Золотой червонец 1923 года.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		5. Валютные блоки и этапы кризиса Генуэзской валютной системы. 6. Цели создания, принципы построения и фундаментальные причины кризиса Бреттон-Вудской валютной системы. 7. Принципы устройства и механизм действия Ямайской валютной системы. 8. Специальные права заимствования SDRs как инструмент мировой валютной системы. 9. Преимущества и проблемы функционирования Европейской валютной системы. 10. Мировая валютная система как международный регулятор расчетов по поддержанию экономического роста и внешнеторгового обмена. 11. Валютный курс как инструмент финансовой политики государства и валютные интервенции. 12. Формирование и основные задачи Международного валютного фонда (МВФ). 13. Международный банк реконструкции и развития МБРР (Мировой банк) и кредитование экономического развития. 14. Структура Мирового (Всемирного) банка: Международная ассоциация развития; Международная финансовая корпорация, Многостороннее агентство по гарантированию инвестиций, Международный центр урегулирования инвестиционных споров. 15. Риски на мировом финансовом рынке: валютный риск. ***Направления исследований для зачета с оценкой:*** 1. Возможности криптовалюты и перспективы поливалютной системы. 2. Системные валютные риски на мировом финансовом рынке. 3. Валюта как специальное средство международных расчетов, валютный рынок и банковские операции на валютном рынке. 4. Мировая валютная система как форма организации международных валютных отношений, закрепляемая межгосударственными соглашениями. 5. Ликвидность международных валютно-финансовых рынков как характеристика конвертируемости валют. 6. Роль резервной валюты на мировом финансовом рынке. 7. Причины, особенности проявления и последствия мировых валютных кризисов. 8. Модели валютных кризисов: модель П. Кругмана. 9. Модели валютных кризисов: модель с фиксированным валютным курсом. 10. Модели валютных кризисов: модель спекулятивной атаки. 11. Модели валютных кризисов: модель с фактором уверенности. Модели валютных кризисов: модель асимметрии информации.
Теоретические и методологические основы бизнеса		
ОПК-1.1	Использует фундаментальные экономические знания (на продвинутом уровне) при решении практических и (или) исследовательских	***Перечень теоретических вопросов к зачету:*** 1. Сущность предпринимательства как специфического вида деятельности. 2. Концепции теории развития предпринимательства. 3. Исторический аспект развития предпринимательства. 4. Основные направления предпринимательской деятельности. 5. Характеристика объекта и субъектов предпринимательской деятельности. 6. Предпринимательская среда и условия ее функционирования.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	задач в профессиональной области	7. Внешняя и внутренняя среда предпринимательства. 8. Понятие инфраструктуры бизнеса и ее основные элементы. 9. Основные организационные формы бизнеса. 10. Характеристика некоммерческих предприятий. 11. Малый, средний и крупный бизнес. ***Примерные практические задания для зачета:*** Задание 1. Предполагается проанализировать привлекательность отраслей для развития малого предпринимательства в определенном регионе. Оценка результатов анализа кейса строится исходя из обоснованности выбора отрасли для развития малого предпринимательства (учтены такие факторы предпринимательской деятельности, как (1) потенциальная емкость рынка, (2) особенности поведения потребителей, (3) уровень ценовой конкуренции, (4) технологическое развитие отрасли, (5) правовая защита бизнеса, (6) состояние промышленно-производственной базы, (7) условия финансирования; кроме того, дополнительно оцениваются адекватность выбора целевой аудитории, формы и методы продвижения продукта/технологии на рынке и стимулирования потребительской активности). Максимальная оценка за выполнение кейса составляет 10 баллов. Отсутствие или некачественная проработка одного из факторов предпринимательской деятельности приводит к снижению оценки на 1 балл.
ОПК-1.2	Выбирает наиболее подходящую теоретическую модель для решения (на продвинутом уровне) практических или исследовательских задач экономической направленности и обосновывает свой выбор	***Перечень теоретических вопросов к зачету*** 1. Характеристика предприятий малого бизнеса. Достоинства и недостатки предприятий малого бизнеса. 2. Характеристика фирм крупного бизнеса (холдинги, ассоциации, концерны, консорциумы). 3. Понятие предприятия и фирмы. Признаки классификации предприятий. 4. Характеристика механизма деятельности предприятия. 5. Процесс организации нового предприятия. 6. Бизнес-планирование в деятельности предпринимателей. 7. Реорганизация и ликвидация предприятия. 8. Несостоятельность (банкротство) предпринимательских организаций. 9. Конкуренция в системе бизнеса. 10. Типы конкурентов. Выбор формы конкурентного поведения фирмы. 11. Лизинг как один из приемов предпринимательской деятельности 12. Франчайзинг как интеграционная система крупного и малого бизнеса. ***Примерные практические задания для зачета:*** **Задание 1.** Применяя метод анализа чувствительности, определите чувствительность проекта к изменению объема производства и цене изделия. Исходные данные. Инвестор решает вопрос об инвестировании 570 тыс.рублей в проект. Объем производства и реализации продукции при реализации проекта составит 1500 изделий в месяц. Цена реализации одного изделия – 480 рублей, себестоимость единицы – 290 рублей.Диапазон изменения параметров -80%, 90%, 100%, 110%, 120%. Оценку эффективности проекта произвести за 10 периодов. **Задание 2.** Фирма планирует построить среднее или малое предприятие по производству продукции. Рассматривается

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>вариант строительства среднего предприятия, или малого предприятия с последующим расширением производства через 2 года, если сформируется высокий спрос на продукцию.
Фирма рассматривает задачу на 10-летний период. Маркетинговый анализ рынка показал, что вероятность высокого спроса – 0,65%, низкого спроса – 35%.
Инвестиции в строительство среднего предприятия – 7,5 млн. руб. Инвестиции в малое предприятие – 1,8 млн. руб., затраты на его дальнейшее расширение – 3,4 млн. руб.
Ожидаемые ежегодные доходы:
По среднему предприятию: при высоком спросе – 1,4 млн.руб., при низком – 0,38 млн. руб. ежегодно в течение 10 лет.
По малому предприятию: при высоком спросе – 0,27 млн.руб., при низком – 0,25 млн. руб. ежегодно в течение 2 лет.
После расширения малого предприятия: при высоком спросе – 1,6 млн.руб., при низком – 0,24 млн. руб. ежегодно в течение 8 лет.
Без расширения малого предприятия: при высоком спросе –0,27 млн.руб., при низком – 0,20 млн. руб. ежегодно в течение 8 лет. На основе «дерева решений» выбрать предпочтительный вариант инвестирования.
Задание 3. Рассчитать совокупный предпринимательский риск компании.
Ежегодно производится 100 тыс. единиц продукции. Цена реализации составляет 3500 рублей, средние переменные издержки составляют 1800 руб./шт. Постоянные издержки – 38500 тыс.руб.
Величина собственного капитала организации составляет 800 тыс.руб. Сумма заемных источников – 550 тыс. руб. Средняя процентная ставка по кредитам – 14,5 %. Ставка налога на прибыль – 20%.
Задание 4. Предложены следующие варианты сценариев реализации предпринимательских проектов.
Таблица 3.3
Сценарии реализации предпринимательских проектов
<table>
<tr><th>Состояние экономики</th><th>Вероятность наступления данного состояния</th><th>Проект C, IRR, %</th><th>Проект D, IRR.%</th></tr>
<tr><td>подъем</td><td>0,4</td><td>45</td><td>125</td></tr>
<tr><td>норма</td><td>0,3</td><td>38</td><td>75</td></tr>
<tr><td>спад</td><td>0,3</td><td>15</td><td>20</td></tr>
</table></td></tr>
<tr><td>ОПК-1.3</td><td>Составляет план и осуществляет исследования реальной экономической ситуации (на продвинутом уровне) с применением методов фундаментальной экономической науки</td><td>Перечень теоретических вопросов к зачету:
1. Лизинг как один из эффективных приемов предпринимательской деятельности.
2. Конкуренция как внутренний регулятор рыночной экономики.
3. Сущность предпринимательских рисков, их классификация.
4. Управление предпринимательскими рисками.
5. Налоговая система: плательщики, принципы налогообложения, объекты налогообложения. Основные виды налогов.
6. Характеристика различных режимов налогообложения.
7. Сущность предпринимательской (коммерческой) тайны. Перечень сведений, составляющих предпринимательскую тайну.</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		8. Механизмы защиты предпринимательской тайны. 9. Сущность культуры предпринимательства. 10. Предпринимательская этика и этикет. ***Примерные практические задания для зачета:*** Предполагается провести анализ проблем малого предпринимательства. Задача кейса – исходя из выбранного из предложенного перечня текста, описывающего предпринимательский проект определенного лица или историю развития конкретного малого предприятия – провести анализ по следующей схеме (примерный перечень вопросов может и должен корректироваться исходя из материалов для анализа): - что было первично: стремление стать предпринимателем или некое открытие (научная разработка), которая, как выяснилось, пригодна для коммерциализации? - кто стоял у истоков: отдельное лицо, группа единомышленников, изобретатель и поддержавший его предприниматель (бизнес-ангел) и т.д.? - каковы были мотивы для предпринимательского старта? - как формировалась предпринимательская команда (источники и формы привлечения к участию в старт-апе)? как по мере развития проекта видоизменялись ролевые функции участников? Были ли случаи покидания команды? По какой причине и в какой форме (конфликт и т.п.)? - какова была роль ближайшего окружения предпринимателя(ей)? - каковы были проблемы начального этапа? Какие методы и инструменты их преодоления были найдены? - были ли известны потенциальные клиенты будущей фирмы? Как осуществлялся их поиск? - как решались проблемы привлечения финансовых ресурсов на начальном этапе? - на какие социальные ресурсы (сети и т.д.) опирался проект в начальной стадии? - стал ли проект с самого начала единственным (главным) источником дохода для предпринимателя (предпринимательской команды)? - какие конфликты возникали по мере развития проекта? Как они преодолевались? - изменились ли – и если изменились, то как – первоначальные мотивы по мере роста и развития бизнеса у его инициаторов? - какие события (этапы) в собственной жизни и карьере предприниматели рассматривают как наиболее важные для принятия впоследствии решения о предпринимательском старте? Оценка результатов анализа кейса производится исходя из полноты и глубины проведенного исследования предложенной для анализа ситуации. Максимальная оценка за выполнение кейса составляет 10 баллов. Отсутствие или некачественная проработка проблем предпринимательской деятельности приводит к снижению оценки. **Задание 2.** Рассчитать совокупный предпринимательский риск компании. Ежегодно производится 100 тыс. единиц продукции. Цена реализации составляет 3500 рублей, средние переменные издержки составляют 1800 руб/шт. Постоянные издержки – 38500 тыс.руб. Величина собственного капитала организации составляет 800 тыс.руб. Сумма заемных источников – 550 тыс. руб. Средняя процентная ставка по кредитам – 14,5 %. Ставка налога на прибыль – 20%. **Задание 2.** Предложены следующие варианты сценариев реализации предпринимательских проектов.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

Таблица 3.3

Сценарии реализации предпринимательских проектов

Состояние экономики	Вероятность наступления данного состояния	Проект С, IRR, %	Проект D, IRR.%
подъем	0,4	45	125
норма	0,3	38	75
спад	0,3	15	20

Задание 3. Правильно ли оценены ценные бумаги, если ставка свободная от риска составляет 8%.Доходность акций компании А оценивается в 16,1%, акций В – 22,4%. Бета акций А- 0,9, бета акций В- 1,6.

Задание 4. Применяя метод анализа чувствительности, определите чувствительность проекта к изменению объема производства и цене изделия.

Исходные данные. Инвестор решает вопрос об инвестировании 570 тыс.рублей в проект. Объем производства и реализации продукции при реализации проекта составит 1500 изделий в месяц. Цена реализации одного изделия – 480 рублей, себестоимость единицы – 290 рублей.Диапазон изменения параметров -80%, 90%, 100%, 110%, 120%.

Оценку эффективности проекта произвести за 10 периодов.

Задание 5. Фирма планирует построить среднее или малое предприятие по производству продукции. Рассматривается вариант строительства среднего предприятия, или малого предприятия с последующим расширением производства через 2 года, если сформируется высокий спрос на продукцию.

Фирма рассматривает задачу на 10-летний период. Маркетинговый анализ рынка показал, что вероятность высокого спроса – 0,65%, низкого спроса – 35%.

Инвестиции в строительство среднего предприятия – 7,5 млн. руб. Инвестиции в малое предприятие – 1,8 млн. руб., затраты на его дальнейшее расширение – 3,4 млн. руб.

Ожидаемые ежегодные доходы:

По среднему предприятию: при высоком спросе – 1,4 млн.руб., при низком – 0,38 млн. руб. ежегодно в течение 10 лет.

По малому предприятию: при высоком спросе – 0,27 млн.руб., при низком – 0,25 млн. руб. ежегодно в течение 2 лет.

После расширения малого предприятия: при высоком спросе – 1,6 млн.руб., при низком – 0,24 млн. руб. ежегодно в течение 8 лет.

Без расширения малого предприятия: при высоком спросе –0,27 млн.руб., при низком – 0,20 млн. руб. ежегодно в течение 8 лет. На основе «дерева решений» выбрать предпочтительный вариант инвестирования.

Примерный перечень тем комплексной исследовательской работы:

Оптимизация риска налогового портфеля (в организациях различных сфер деятельности).

Совершенствование методов (инструментов, механизмов) управления рисками проектного финансирования.

Повышение роли риск-менеджмента в системе управления финансовой деятельностью современной корпорации.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Развитие методов оценки риска и их влияния на рыночную стоимость предприятия. Совершенствование методов (инструментов) оценки рисков финансовых активов предприятия. Совершенствование методов (инструментов) оценки рисков информационных систем и ресурсов предприятия. Совершенствование методов (инструментов, механизма) управления риском портфеля ценных бумаг предприятия. Совершенствование методов (инструментов, механизма) управления валютным риском предприятия. Совершенствование методики (инструментария, механизмов) прогнозирования и мониторинга развития страхования и рынка страховых услуг. Совершенствование финансового и налогового регулирования развития и эффективного функционирования обязательного и добровольного страхования. Формирование новых видов страховых продуктов как необходимый компонент повышения конкурентоспособности страхового бизнеса. Разработка методов (инструментов, механизмов) повышения конкурентоспособности страховых услуг. Разработка методов (инструментов, механизмов) повышения конкурентоспособности страховых компаний. Совершенствование методов (инструментов) повышения эффективности инвестиционного портфеля страховой компании. Совершенствование методов составления рейтингов и раскрытия информации страховых компаний. Совершенствование методов составления рейтингов и раскрытия информации паевых инвестиционных фондов. Совершенствование методов составления рейтингов и раскрытия информации пенсионных фондов. Исследование рисков развития современного банковского сектора российской экономики. Совершенствование механизмов (инструментов) управления рисками межбанковской конкуренции. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) оценки и обеспечения надежности коммерческого банка. Совершенствование методов оценки портфеля активов российских банков и его оптимизации.
Финансовые рынки, алгоритмический трейдинг и портфельное управление		
ОПК-1.1	Использует фундаментальные экономические знания (на продвинутом уровне) при решении практических и (или) исследовательских задач в профессиональной области	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Что представляет собой финансовый рынок? 2. Определите структуру финансового рынка. 3. Какие функции исполняет валютный рынок в системе финансового рынка? 4. Назовите функции финансового рынка. 5. За которыми критериям можно классифицировать финансовые рынки? 6. В чем заключаются различия между инструментами займа и инструментов собственности? 7. Назовите функции, которые выполняет финансовый рынок. 8. В чем заключается отличие первичного и вторичного рынков? 9. Какие основные субъекты финансового рынка? 10. По какому признаку финансовый рынок разделяется на денежный и рынок капиталов?

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		11. Какие функции выполняет кредитный рынок в системе финансового рынка? 12. Какие свойства имеют ценные бумаги? 13. В чем проявляется тождество денег и ценных бумаг, в чем их различие? 14. Дайте определение финансовым посредникам. 15. Назовите составляющие банковской системы Украины. 16. Какие составляющие системы Национального банка? 17. Какие основные операции выполняют коммерческие банки? 18. В чем сущность универсальных банков, определите их отличие от специализированных? 19. Как классифицируются банки по специализации? 20. Предоставьте характеристику типам объединений, которые могут создаваться при участии банков. 21. Назовите основные виды небанковских финансовых институтов, действующих на территории Украины. Которые основные формы их деятельности? 22. С какой целью создаются кредитные союзы? 23. В чем заключаются отличия между кредитными союзами и другими депозитными институтами? 24. В чем сущность существование институтов совместного инвестирования? 25. Назовите направления профессиональной деятельности по купле-продаже ценных бумаг на фондовом рынке. 26. В чем заключается расширительное толкование роли торгового агента па фондовом рынке? 27. Что такое брокерская деятельность на фондовом рынке? 28. Что такое дилерская деятельность на рынке ценных бумаг? 29. Какие виды лицензий па осуществление деятельности в качестве торгового агента вы знаете? 30. С какими видами деятельности па фондовом рынке возможно совмещение брокерской и дилерской деятельности? 31. Какие функции выполняет контролер в штате профессионального участника рынка ценных бумаг? 32. Что понимается под деятельностью, но управлению ценными бумагами? 33. Что называется клиринговой деятельностью па фондовом рынке? 34. Что такое депозитарная деятельность? 35. Что понимается под деятельностью по ведению реестра владельцев ценных бумаг? 36. Кто такой трансфер-агент? Какие функции он выполняет в системе ведения реестра? 37. Что понимается под деятельностью по организации торговли на рынке ценные бумаг? 38. В чем заключается роль фондовых бирж на рынке ценных бумаг? 39 Дайте определение биржевого дела. 40. Кто такой организатор торговли па рынке цепных бумаг? 41. Какие категории руководителей и служащих организаторов торговли подлежат обязательной аттестации? 42. Дайте определение понятия «лицензия профессионального участника рынка ценных бумаг». 43. Охарактеризуйте требования, применяемые при оценке квалификации специалистов.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		44. Перечислите регистры внутреннего учета профессиональных участников рынка ценных бумаг. 45. Сформулируйте требования к оформлению учетных регистров. 46. Назовите характерные особенности учетных регистров. 47. С какой периодичностью осуществляется отчетность профессиональных участников рынка ценных бумаг перед клиентами? 48. Назовите организации, осуществляющие контроль за деятельностью профессиональных участников рынка ценных бумаг. 49. Какой организации и на каких условиях профессиональные участники должны представлять учетные регистры и внутреннюю отчетность? 50. В чем состоит суть портфельного инвестирования? 51. Какие преимущества получает инвестор, формируя инвестиционный портфель, по сравнению с моноинвестированием? 52. Перечислите основные и локальные цели портфельного инвестирования. 53. Назовите основные типы инвестиционных портфелей. Дайте им характеристику. 54. Какие существуют основные подходы к формированию портфеля финансовых инвестиций? 55. Перечислите основные этапы формирования портфеля ценных бумаг.
ОПК-1.2	Выбирает наиболее подходящую теоретическую модель для решения (на продвинутом уровне) практических или исследовательских задач экономической направленности и обосновывает свой выбор	***Примерные практические задания для экзамена:*** 1. Используя данные интернет-ресурса http://cbr.ru/statistics, определите достаточность золотовалютных резервов стран мира за текущий период времени. Проведите динамический и сравнительный анализ показателей, сопоставляя с данными, представленными в задаче 1. Сделайте выводы. 2. Для анализа динамики объема и показателя достаточности международных резервов отдельных стран проведите расчет коэффициента Гринспена и Гвидотти, а также темпов прироста, используя данные, представленные на официальном сайте Банка России. Сделайте выводы. 3. Определите среднюю ожидаемую прибыль, ожидаемую стоимость информации при условиях определенности и неопределенности, а также стоимость полной информации. Если предприниматель стоит перед выбором, сколько ему закупить товара: 100 или 200 единиц. При закупке 100 единиц товара затраты составят 120 тыс. р. за единицу, а при закупке 200 единиц – 100 тыс. р. за единицу. Предприниматель данный товар будет продавать по 180 тыс. р. за единицу. Однако он не знает, будет ли спрос на него. Весь не проданный в срок товар может быть реализован только по цене 90 тыс. р. и менее. При продаже товара вероятность составляет «50 на 50», т.е. существует вероятность 0,5 для продажи 100 единиц товара и 0,5 для продажи 200 единиц. 4. Выберите наименее рискованный вариант вложения капитала путем сравнения значений коэффициентов вариации. Первый вариант. Прибыль при средней величине 30 млн р. колеблется от 15 до 40 млн р. Вероятность получения прибыли в 15 млн р. равна 0,2 и прибыли в 40 млн р. – 0,3. Второй вариант. Прибыль при средней величине 25 млн р. колеблется от 20 до 30 млн р. Вероятность получения прибыли в 20 млн р. равна 0,4 и прибыли в 30 млн р. – 0,3.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
ОПК-1.3	Составляет план и осуществляет исследования реальной экономической ситуации (на продвинутом уровне) с применением методов фундаментальной экономической науки	***Примерные практические задания для экзамена:*** 1. Имеются следующие данные: денежные средства – 70 тыс. руб.; краткосрочные финансовые вложения – 28 тыс. руб.; дебиторская задолженность – 130 тыс. руб.; основные средства – 265 тыс. руб.; нематериальные активы – 34 тыс. руб.; производственные запасы – 155 тыс. руб., кредиторская задолженность – 106 тыс. руб., краткосрочные кредит банка – 95 тыс. руб.; долгосрочные кредиты – 180 тыс. руб. Определите коэффициент текущей ликвидности, коэффициент срочной ликвидности, коэффициент абсолютной ликвидности. 2. Экономика страны характеризуется следующими данными: естественный уровень безработицы равен 5%; фактический уровень безработицы - 6,5%. Правительство поставило задачу обеспечить полную занятость. Для этого предпринимаются меры, стимулирующие рост реального ВВП. По прогнозам, в следующем году снижение фактического ВВП замедлится, в результате чего отставание фактического ВВП от потенциального составит 1,5%. На сколько (в %) изменится в следующем году отставание фактического объема производства от ВВП, соответствующего полной занятости (коэффициент чувствительности ВВП к динамике циклической безработицы равен 2)? 3. В экономике страны совокупный объем выпуска равен 800 млрд. долл., располагаемый доход – 666 млрд. долл., потребительские расходы – 609 млрд. долл., сальдо государственного бюджета составляет 35 млрд. долл., дефицит торгового баланса равен 20 млрд. долл. Определите государственные закупки, частные сбережения, инвестиции. 4. В экономике страны располагаемый доход равен 5800 млрд. долл., потребительские расходы – 5200 млрд. долл., инвестиции – 1400 млрд. долл., дефицит торгового баланса составляет 150 млрд. долл. Определите состояние государственного бюджета. 5. Центральный банк покупает на отрытом рынке государственные бумаги стоимостью 1 млн. ден. ед. Все вырученные деньги поступают на счет продавца в банке. Покажите, каким будет непосредственное влияние этой операции на объем денежной массы и какие дальнейшие изменения будут иметь место в этом случае? Что произошло бы в случае, если все деньги продавец ценных бумаг получил наличными?
Финансы и кредит (продвинутый уровень)		
ОПК-1.1	Использует фундаментальные экономические знания (на продвинутом уровне) при решении практических и (или) исследовательских задач в профессиональной области	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Сущность финансов в системе денежных отношений рыночного хозяйства. 2. Условия возникновения финансов. 3. Функции финансов. 4. Роль финансов в общественном воспроизводстве. 5. Понятие и структура финансовой системы страны. 6. Сущность финансовой политики. 7. Понятие об управлении финансами. 8. Органы управления финансами в РФ. 9. Сущность финансового контроля. 10. Организация финансового контроля. 11. Виды финансового контроля.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		12. Риск как экономическая категория. 13. Сущность, факторы и виды неопределенности. 14. Сущность и причины риска. 15. Классификация рисков по различным признакам. 16. Понятие финансового риска, его место в общей системе рисков предприятия. 17. Характеристика финансовых рисков, их видов и факторов, оказывающих влияние на риски. 18. Характеристика инвестиционных рисков, их видов и факторов, оказывающих на них влияние. 19. Структура, функции и участники финансовых рынков. 20. Виды и функции финансовых посредников. 21. Характеристика инвестиционного рынка. 22. Характеристика валютного рынка. 23. Характеристика фондового рынка. 24. Характеристика рынка ссудных капиталов. 25. Срочный рынок: строение, инструменты, участники. 26. Природа и сущность спекулятивного и чистого риска. 27. Регулирование финансового рынка. 28 Формы государственного кредита и их назначение. 29 Финансовое планирование и прогнозирование. 30. Место финансов хозяйствующих субъектов в финансовой системе государства. 31. Основы организации финансов в разных сферах деятельности. 32. Финансовые ресурсов предприятий, источники их формирования и направления использования. 33. Прибыль и рентабельность предприятия. 34. Сущность и функции государственных и муниципальных финансов. 35. Принципы функционирования государственных и муниципальных финансов. 36. Бюджет как основное звено системы государственных финансов. 37. Состав и классификация доходов бюджетов. 38. Состав и классификация расходов бюджетов. 39. Экономическая природа внебюджетных фондов. 30. Принципы построения бюджетной системы России. 31. Бюджетный процесс и его основные этапы. 32. Порядок и особенности исполнения бюджета. 33. Порядок подготовки и утверждения правительства об исполнении бюджета. 34. Бюджетный федерализм и его принципы. 35. Сущность и основные формы бюджетного регулирования в России. 36. Сущность и значение государственного и муниципального кредита.

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>37. Государственные и муниципальные займы.
38 Особенности функционирования органов общей компетенции в системе управления государственными финансами.
39. Функции Президента России в процессе управления финансовыми отношениями.
40. Функции Государственной думы РФ в процессе управления финансовыми отношениями.
41. Функции Совета федерации РФ в процессе управления финансовыми отношениями.
42. Цели, задачи и особенности функционирования Счетной палаты России.
43. Основные задачи Правительства России в процессе управления финансовыми отношениями.
44. Основные задачи и функции Министерства финансов РФ.
45. Основные задачи и функции органов федерального казначейства.
46. Основные задачи и функции контрольно – ревизионных органов.
47. Основные задачи и функции федеральной налоговой службы.
48 Основные задачи и функции центрального банка России в процессе управления финансовыми отношениями.
49. Валютная система РФ.
50. Платежный баланс.
51. Основные международные финансовые организации и участие России в них.
52. Государственный внешний долг: сущность, причины, виды и формы.
53. Понятие и структура кредитной системы.
54. Институциональная структура современной кредитной системы России.
55. Особенности кредитования заемщиков.
56.Направления кредитной политики коммерческих банков.</td></tr>
<tr><td>ОПК-1.2</td><td>Выбирает наиболее подходящую теоретическую модель для решения (на продвинутом уровне) практических или исследовательских задач экономической направленности и обосновывает свой выбор</td><td>Примерные практические задания для экзамена:
1. По исходным данным о деятельности двух предприятий (таблица 1) установить, какому риску подвергаются эти предприятия и у кого из них возможны большие расходы. Обоснуйте свой выбор.
Таблица 1.
<table>
<tr><td>Показатели</td><td>Значение</td></tr>
<tr><td>1.Постоянные годовые расходы предприятия, тыс. руб</td><td>600</td></tr>
<tr><td>2.Переменные расходы от годового объема продаж:
- предприятие А, %
- предприятие Б, %</td><td>13
24</td></tr>
<tr><td>3. Запланированный объем продаж на год, тыс. руб.</td><td>720</td></tr>
</table></td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
<table>
<tr><td>4.Возможное снижение спроса на продукцию каждого предприятия, %</td><td>15</td></tr>
</table>

2. Кредитная организация планирует открыть новый филиал по обслуживанию клиентов.
Открытие филиала по проведению депозитных операций принесет организации прибыль в 6 млн. руб., открытие филиала по предоставлению кредитов – прибыль в размере 10 млн. руб.
Возможно открытие универсального филиала, проводящего как депозитные, так и кредитные операции, что принесет прибыль в 14,2 млн. руб.
Имеется вероятность открытия по соседству с новым филиалом центрального офиса конкурирующего банка. При этом убытки от открытия филиала по проведению депозитных операций составят 2,5 млн. руб., от открытия филиала по предоставлению кредитов – 7,5 млн. руб., от открытия универсального филиала – 10,8 млн. руб. Точная информация об открытии офиса банка-конкурента отсутствует.
Постройте дерево решений и определите, чему равны средние ожидаемые выигрыши для всех альтернатив.

3.Капитал банка составляет 90 млн. рублей. Определить: 1) соответствие открытых валютных позиций лимитам, установленных Банком России; 2) суммарную валютную позицию.
<table>
<tr><td>Валюта</td><td>Длинная открытая валютная позиция в рублях</td><td>Короткая открытая валютная позиция в рублях</td></tr>
<tr><td>Доллар</td><td>8 млн. руб.</td><td></td></tr>
<tr><td>ЕВРО</td><td></td><td>4 млн.руб.</td></tr>
<tr><td>Золото</td><td></td><td>5 млн.руб.</td></tr>
</table>

4.Определить требуемый Банком России размер резервного фонда, если на 01,11 на балансе банка находятся остатки следующих ссуд:
60 тыс. руб. - текущие ссуды;
30 тыс. руб. - обеспеченные ссуды с просроченными процентами в 9 дней;
20 тыс. руб. - ссуды, обеспеченные поручительством субъектов РФ, просроченные 35 дней;
15 тыс. руб. - текущие ссуды инсайдерам;
10 тыс. руб. - обеспеченные ссуды, просроченные свыше 180 дней.
25 тыс. руб. - льготные ссуды.
Аргументируйте ответ.
</td></tr>
<tr><td>ОПК-1.3</td><td>Составляет план и осуществляет исследования реальной</td><td>
Примерные практические задания для экзамена:
1.По исходным данным конкретного предприятия необходимо:
- оценить абсолютные и относительные показатели финансовой устойчивости предприятия;
</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	экономической ситуации (на продвинутом уровне) с применением методов фундаментальной экономической науки	- провести анализ вероятности возникновения несостоятельности (банкротства) предприятия; - оценить уровень текущей и перспективной платежеспособности предприятия. 2. Проанализируйте достаточность источников финансирования для формирования запасов ООО «XXX», если собственный капитал предприятия 10 000 тыс. руб., валюта баланса составляет 20 000 тыс.руб. Коэффициент финансовой устойчивости имеет уровень: 0,75; 0,6. Определите, каков размер долгосрочных обязательств на балансе предприятия в каждом случае? По балансу ООО «XXX» рассчитайте коэффициенты, характеризующие финансовую устойчивость данного предприятия на конец отчетного года. Сравните расчетные значения этих коэффициентов с нормативными. Дайте оценку характера финансовой устойчивости ООО «XXX», исходя из трехкомпонентного показателя типа финансовой ситуации. Определите, к какому классу организаций по критериям оценки финансового состояния относится ООО «XXX» в конце отчетного периода. Как изменится коэффициент автономии ООО «XXX», если его собственные средства в следующем году возрастут по сравнению с отчетным годом на 70 тыс. руб., а общая величина активов увеличится на 110 тыс. руб.? Как изменится коэффициент финансовой устойчивости ООО «XXX», если оно получит кредит на сумму 5500 тыс. руб. сроком на 3 года. 3. Выполнить финансовую диагностику предприятия по данным таблицы. Оценить финансовую устойчивость предприятия. Исходные данные:

Наименование показателя	на 01.01.2019	на 01.04.2019	на 01.07.2019
Собственный капитал, ден. ед.	41121245	38122732	38765576
Долгосрочные обязательства, ден. ед.	0	0	0
Текущие обязательства, ден. ед.	12977657	14746046	15141807
Необоротные активы, ден. ед.	47592033	47581413	41550334
Производственные запасы, ден. ед.	317871	319616	346366
Незавершенное производство, ден. ед.	219979	220958	306443
Авансы поставщикам, ден. ед.	316226	314456	359035

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		4.Сравните эффективность использования заемного капитала компанией "Dublin Computer Sistem" за 2019 и 2020 года. В 2019 году прибыль до уплаты процентов и налогов (EBIT) компании составила 5 639 тыс. долл., а в 2020 году 6 933 тыс. долл.; собственный капитал в 2019 году 12.7 млн. долл. и 14.8 млн. долл. соответственно в 2020 году; заемный капитал в 2019 году 18.5 млн. долл. и 20.7 в 2020 году; средневзвешенная цена заемных ресурсов 7.7% в 2019 году и 6.4% в 2020 году; темп инфляции 3.0% в 2019 году и 3.6% в 2020 году, уровень налогообложения 25.5% и 27% соответственно в 2019 и 2020 годах. 5. Рассчитайте изменение уровня финансового левериджа для предприятия "СМУ №5" в 2017, 2018 и 2019 годах, если соответственно: - объем чистой прибыли увеличился на 2.4%, 2.8%, 3.1%; - валовая прибыль увеличилась на 1.1%, 2.3%, 1.4% Предприятия А, Б и С закончили год со следующими финансовыми результатами: - рентабельность совокупного капитала соответственно для А - 26.1%, Б - 27.3% и С - 23.8%; - средневзвешенная цена заемных ресурсов 16.4%, 14.4% и 11.9%; - собственный капитал на конец года 22.8 млн. рублей, 34.1 млн. рублей и 13.5 млн. рублей; - заемный капитал на конец года 20.9 млн. рублей, 12.3 млн. рублей и 30.2 млн. рублей. Уровень налогообложения 20%. Какое предприятие эффективнее использует заемные средства?
Учебная – научно-исследовательская работа (получение первичных навыков научно-исследовательской работы)		
ОПК-1.1	Использует фундаментальные экономические знания (на продвинутом уровне) при решении практических и (или) исследовательских задач в профессиональной области	***Практические задания:*** 1. Составление плана работы магистранта. 2. Ознакомление с тематикой научных исследований, изучение научной литературы и иных источников по исследуемой теме, определение проблемы исследования, основных подходов по теме исследования. 3. Постановка исследовательских цели, задач, определение объекта и предмета научного исследования. 4. Выбор методологии исследования. 5. Формирование перечня источников по выбранной теме научно-исследовательской деятельности, проведение исследований, выдвижение научных гипотез. 6. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов исследования научному сообществу. 7. Подготовка текста выпускной квалификационной работы
ОПК-1.2	Выбирает наиболее подходящую теоретическую модель для решения (на продвинутом уровне) практических или исследовательских	

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	задач экономической направленности и обосновывает свой выбор	
ОПК-1.3	Составляет план и осуществляет исследования реальной экономической ситуации (на продвинутом уровне) с применением методов фундаментальной экономической науки	
Учебная – практика по получению первичных профессиональных умений и навыков		
ОПК-1.1	Использует фундаментальные экономические знания (на продвинутом уровне) при решении практических и (или) исследовательских задач в профессиональной области	**Задание на практику:** – организовать библиографический поиск литературных и электронных научных, нормативно-методических и учебных источников отечественных и зарубежных авторов для уточнения темы и проблем магистерского исследования, сформулировать цели, задачи, актуальность исследуемой проблемы, научной новизны; – исследовать научную проблему и составить обзор литературных, научных и нормативно-методических источников отечественных и зарубежных авторов для написания научных статей, докладов, теоретической части выпускной квалификационной работы; – обработать информацию методами и приемами, предусмотренными в программе исследования; – сформулировать собственное мнение по проблемам исследования, выводы и предложения по совершенствованию управления рисками на исследуемом предприятии; - составить отчет по практике и подготовить его к защите
ОПК-1.2	Выбирает наиболее подходящую теоретическую модель для решения (на продвинутом уровне) практических или исследовательских задач экономической направленности и обосновывает свой выбор	

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
ОПК-1.3	Составляет план и осуществляет исследования реальной экономической ситуации (на продвинутом уровне) с применением методов фундаментальной экономической науки	
ОПК-2 – Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях		
Эконометрика (продвинутый уровень)		
ОПК-2.1	Работает с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах	**Перечень теоретических вопросов к зачету:** 1. На каком сайте можно найти информацию для моделирования цены финансовых активов 2. Какие требования предъявляются к факторам, включаемым в уравнение регрессии? 3. Что такое выборочное исследование 4. Что понимается под линейной множественной регрессией? 5. Чем отличаются стандартизованные коэффициенты регрессии от коэффициентов в естественном виде? 6. Что показывает отрицательное значение коэффициента эластичности? 7. Чем отличаются частный и общий критерии Фишера? 8. Что понимается под коллинеарностью и мультиколлинеарностью факторов? 9. Как проверяется наличие коллинеарности и мультиколлинеарности? **Практические задания** По данным сайта gks.ru отобрать признаки. характеризующие социально -экономическое положение регионов РФ По исходным данным построить поле корреляции Полигон частот и гистограмму найдите коэффициента корреляции . Оценить распределение ..Сделать расчет основных числовые характеристики по результатам выборки: выборочное среднее, дисперсия, среднее квадратическое отклонение
ОПК-2.2	Обрабатывает информацию об экономических явлениях и процессах, определяет связи и зависимости между элементами информации, формулирует	**Перечень теоретических вопросов к зачету:** 1 Перечислите все виды моделей, нелинейных относительно: а) включаемых переменных; б) оцениваемых параметров. 2 Как проводится подбор линеаризующего преобразования для внутренне нелинейных моделей? 3 Назовите показатели корреляции, используемые при нелинейных соотношениях рассматриваемых признаков. 4 Какие задачи решаются при построении уравнения регрессии? 5 Какой вид имеет система нормальных уравнений метода наименьших квадратов в случае линейной регрессии? 6. По какой формуле вычисляется индекс множественной корреляции? 7. Как вычисляются индекс множественной детерминации и скорректированный индекс множественной детерминации? 8. Как проверяется значимость уравнения регрессии и отдельных коэффициентов

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	обоснованный вывод	**Практические задания** По данным сайта gks.ru отобрать признаки. характеризующие социально =экономическое положение регионов РФ. Проверить их на нормальность. Найти уравнение регрессии y = a + bx методом наименьших квадратов. . Построить график: исходные точки и уравнение регрессии. Дать интерпретацию коэффициентов
ОПК-2.3	Владеет современными методами экономического анализа, статистики и эконометрики для решения теоретических и прикладных задач	**Перечень вопросов для подготовки к зачету** 1. Какие требования предъявляются к факторам, включаемым в уравнение регрессии? 2. Что такое выборочное исследование 3. Что понимается под линейной множественной регрессией? 4. Чем отличаются стандартизованные коэффициенты регрессии от коэффициентов в естественном виде? 5. Что показывает отрицательное значение коэффициента эластичности? 6. Чем отличаются частный и общий критерии Фишера? 7. Что понимается под коллинеарностью и мультиколлинеарностью факторов? Как проверяется наличие коллинеарности и мультиколлинеарности? **Практические задания** По 20 предприятиям региона определить зависимость выработки продукции на одного работника *y* (тыс.руб.) от ввода в действие новых основных фондов x_1 (% от стоимости фондов на конец года) и от удельного веса рабочих высокой квалификации в общей численности рабочих x_2 (%). **Тесты** 1 Эндогенными переменными называются Выберите один ответ: 1 независимые переменные 2 зависимые переменные 3 математические ожидания линейные коэффициенты 2 Одним из индикаторов определения наличия мультиколлинеарности между признаками является превышение парным коэффициентом корреляции величины Выберите один ответ 1. 0,8 2. –0,8 3. 3 1 4. 0 5. –1 3 Если предпосылки метода наименьших квадратов нарушены, то Выберите один ответ: 1 полученное уравнение статистически незначимо 2 оценки параметров могут не обладать свойствами эффективности, состоятельности, несмещенности

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		коэффициент регрессии является несущественным 3 коэффициент корреляции является несущественным 4 Экономические переменные могут выступать в одних моделях Выберите один ответ: 1. как эндогенные, а в других – как экзогенные переменные 2. как эндогенные, а в других – как фиктивные переменные 3. как экзогенные, а в других – как фиктивные переменные только как эндогенные переменные
Финансовый анализ		
ОПК-2.1	Работает с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах	**Вопросы к зачету** 1. Виды, методы и информационное обеспечение финансового анализа. 2. Показатели, факторы и результаты финансово-экономической деятельности организации. 3. Комплексная оценка результатов и эффективности деятельности организации. 4. Понятие экономического потенциала организации и его компоненты. Экспресс-анализ. 5. Оценка имущественного положения организации. Анализ основного и оборотного капитала. 6. Оценка финансового положения организации. Анализ ликвидности и платежеспособности. 7. Абсолютные и относительные показатели финансовых результатов. 8. Методика анализа прибыли. 9. Моделирование показателей рентабельности и их анализ. 10. Анализ деловой активности организации. 11. Понятие финансовой устойчивости. 12. Анализ обеспеченности запасов источниками их финансирования. 13. Содержание финансового анализа. Виды финансового анализа. 14. Информационное обеспечение финансового анализа. Бухгалтерская отчетность как источник информации для финансового анализа. 15. Методы финансового анализа и их особенность. Чтение бухгалтерской отчетности. 16. Методика комплексной оценки эффективности хозяйствования. Соотношение экстенсивности и интенсивности использования производственных ресурсов. 17. Анализ и оценка влияния использования производственных ресурсов на объем продукции. 18. Понятие и компоненты экономического потенциала организации. 19. Оценка имущественного и финансового положения организации на основе экспресс-анализа. 20. Активы организации как основа имущественного потенциала. Структурный анализ активов. 21. Понятие основного капитала и его элементы. Задачи и направления анализа. 22. Анализ наличия, движения и структуры основных средств. 23. Оборотный капитал организации. Анализ состава, структуры и динамики оборотных средств.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		24. Анализ состава и структуры источников формирования имущества организации. 25. Расчет и оценка величины собственного оборотного капитала. Анализ обеспеченности оборотных средств собственным оборотным капиталом. 26. Оценка финансового положения на краткосрочную перспективу. Ликвидность и платежеспособность. 27. Группировка активов по степени их ликвидности и пассивов по срокам их погашения. Анализ абсолютных показателей ликвидности. 28. Анализ платёжеспособности организации на основе относительных показателей ликвидности. 29. Показатели и факторы неплатежеспособности (банкротства) организации. 30. Оценка и прогноз платежеспособности организации. 31. Анализ структуры капитала организации. 32. Оперативная оценка финансовой устойчивости. 33. Бухгалтерский баланс и его значение для анализа финансового состояния хозяйствующего субъекта. 34. Анализ отчета о финансовых результатах. 35. Анализ собственного капитала предприятия и долгосрочной платежеспособности. 36. Анализ движения денежных потоков. 37. Дополнительное раскрытие информации в бухгалтерской отчетности для целей финансового анализа. 38. Система показателей эффективности финансово-хозяйственной деятельности организации. 39. Абсолютные показатели финансовых результатов. Механизм формирования прибыли организации. 40. Относительные показатели финансовых результатов, их характеристика и методика расчёта. 41. Моделирование показателей рентабельности. Факторный анализ рентабельности активов (капитала). 42. Резервы повышения прибыли и уровня рентабельности организации. 43. Деловая активность организации как оценка результатов эффективности финансово-хозяйственной деятельности. Анализ оборачиваемости. 44. Характеристика и основные факторы финансовой устойчивости. 45. Типы финансовой устойчивости организации. 46. Анализ финансовой устойчивости на основе соотношения капитала и обязательств организации. 47. Анализ финансовой устойчивости на основе оценки обеспеченности запасов и затрат источниками их формирования. 48. Методика рейтинговой оценки эмитентов: основные характеристики, система оценочных показателей. 49. Сравнительная характеристика программных продуктов по финансовому анализу. 50.Оценка потенциального банкротства организации.
ОПК-2.2	Обрабатывает информацию об экономических явлениях и процессах, определяет связи и	***Задания в тестовой форме:*** Выберите верное утверждение: 1. Основным источником информации для проведения анализа финансового состояния является а) бухгалтерский баланс; б) отчет о движении денежных средств;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	зависимости между элементами информации, формулирует обоснованный вывод	в) отчет об изменения капитала. 2. Источником информации для расчета коэффициента оборачиваемости оборотных активов является… а) бухгалтерский баланс и отчет о финансовых результатах; б) бухгалтерский баланс и отчет о движении денежных средств; в) пояснительная записка к бухгалтерской (финансовой) отчетности. 3. Краткосрочные обязательства – это… а) кредиторская задолженность и дебиторская задолженность; б) краткосрочные кредиты и займы и кредиторская задолженность; в) краткосрочные кредиты и займы, кредиторская задолженность, расчеты по дивидендам с акционерами, прочие краткосрочные пассивы. 3. Ликвидность – это… а) способность организации превращать активы в денежные средства; б) наличие у организации достаточного количества денежных средств для погашения краткосрочных обязательств; в) способность привлечения дополнительных заемных средств для погашения текущих краткосрочных обязательств. 4. Финансовую устойчивость определяют исходя из: а) собственных средств и оборотных активов; б) заемных средств и оборотных активов; в) собственных и заемных средств. 5. Какие из перечисленных обязательств организации относятся к наиболее срочным? а) краткосрочные кредиты и займы; б) кредиторская задолженность; в) долгосрочные кредиты и займы. 6. Краткосрочные обязательства – это… а) кредиторская задолженность и дебиторская задолженность; б) краткосрочные кредиты и займы и кредиторская задолженность; в) краткосрочные кредиты и займы, кредиторская задолженность, расчеты по дивидендам с акционерами, прочие краткосрочные пассивы. 7. К наиболее ликвидным активам относятся … а) денежные средства; б) денежные средства и краткосрочные финансовые вложения; в) краткосрочная дебиторская задолженность. 8. При нормальной финансовой устойчивости запасы обеспечиваются: а) собственными оборотными средствами; б) собственными оборотными средствами и долгосрочными кредитами, и займами; в) собственными оборотными средствами, долгосрочными и краткосрочными кредитами и займами. 9. Для анализа финансовой устойчивости используются показатели. а) рентабельность продаж;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		б) коэффициент независимости; в) коэффициент текущей ликвидности. 10. К наиболее ликвидным активам относятся … а) денежные средства; б) денежные средства и краткосрочные финансовые вложения; в) краткосрочная дебиторская задолженность. 11. В знаменателе формулы определения коэффициента автономии: а) собственный капитал; б) перманентный капитал; в) итог баланса. 12. Коэффициент абсолютной ликвидности рассчитывается … а) $\frac{\text{Денежные средства} + \text{Краткосрочные финансовые вложения}}{\text{Краткосрочные обязательства}}$ б) $\frac{\text{Оборотные активы}}{\text{Краткосрочные обязательства}}$; в) $\frac{\text{Запасы} + \text{Дебиторская задолженность}}{\text{Краткосрочные обязательства}}$. 13. Коэффициент оборачиваемости оборотных активов определяется отношением… а) выручки от продаж отчетного периода к стоимости оборотных активов; б) стоимости всех активов организации к стоимости оборотных активов; в) прибыли от продаж отчетного периода к стоимости оборотных активов
ОПК-2.3	Владеет современными методами экономического анализа, статистики и эконометрики для решения теоретических и прикладных задач	***Практические задания:*** 1. Определите тип финансовой устойчивости предприятия с помощью трехмерного показателя, если известно, что показатели излишек или недостаток собственных средств меньше ноля, излишек или недостаток собственных и долгосрочных заемных средств меньше ноля, излишек или недостаток всех средств предприятия больше ноля. 2. Определить прибыль до налогообложения, если прибыль от реализации продукции составила 1600 тыс. руб., убыток от прочей реализации – 20 тыс. руб., сальдо по финансовым операциям – 60 тыс. руб. 3. На основе расчетов оценить динамику состава и структуры источников финансовых ресурсов предприятия. Результаты анализа должны показать: 1) за счет каких составляющих произошло изменение собственного и заемного капитала; 2) на каком преимущественно капитале работает предприятие (собственном или заемном); 3) содержит ли в себе сложившаяся структура капитала большой риск для инвесторов, благоприятна ли она для эффективного его использования; 4) прирост какого вида источников средств, собственных или заемных, оказал наибольшее влияние на увеличение имущества

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		предприятия за отчетный период. 4. Провести экспресс-анализ бухгалтерского баланса и отчета о финансовых результатах 5. На основе данных финансовой отчетности хозяйствующего субъекта: 1) определить содержание основных показатели Формы «Отчет о финансовых результатах» и показать отличие данных показателей от величины денежных потоков организации. 2) выполнить анализ источников формирования внеоборотных и оборотных активов с целью получения выводов о рациональности их финансирования. Для этого определить сумму собственных оборотных средств и провести факторный анализ их динамики. 6. На основе данных финансовой отчетности хозяйствующего субъекта: 1) Рассчитать необходимые показатели и дать оценку динамики уровня самофинансирования хозяйствующего субъекта. 2) Дать определение чистого денежного потока, его отличий от чистой прибыли.
Учебная – научно-исследовательская работа (получение первичных навыков научно-исследовательской работы)		
ОПК-2.1	Работает с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах	***Практические задания:*** 1. Составление плана работы магистранта. 2. Ознакомление с тематикой научных исследований, изучение научной литературы и иных источников по исследуемой теме, определение проблемы исследования, основных подходов по теме исследования. 3. Постановка исследовательских цели, задач, определение объекта и предмета научного исследования. 4. Выбор методологии исследования. 5. Формирование перечня источников по выбранной теме научно-исследовательской деятельности, проведение исследований, выдвижение научных гипотез. 6. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов исследования научному сообществу 7. Подготовка текста выпускной квалификационной квалификационной работы.
ОПК-2.2	Обрабатывает информацию об экономических явлениях и процессах, определяет связи и зависимости между элементами информации, формулирует обоснованный вывод	
ОПК-2.3	Владеет современными методами экономического анализа, статистики и эконометрики для	

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	решения теоретических и прикладных задач	
Учебная - практика по получению первичных профессиональных умений и навыков		
ОПК-2.1	Работает с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах	**Задание на практику:** – организовать библиографический поиск литературных и электронных научных, нормативно-методических и учебных источников отечественных и зарубежных авторов для уточнения темы и проблем магистерского исследования, сформулировать цели, задачи, актуальность исследуемой проблемы, научной новизны; – исследовать научную проблему и составить обзор литературных, научных и нормативно-методических источников отечественных и зарубежных авторов для написания научных статей, докладов, теоретической части выпускной квалификационной работы; – обработать информацию методами и приемами, предусмотренными в программе исследования; – сформулировать собственное мнение по проблемам исследования, выводы и предложения по совершенствованию управления рисками на исследуемом предприятии; - составить отчет по практике и подготовить его к защите
ОПК-2.2	Обрабатывает информацию об экономических явлениях и процессах, определяет связи и зависимости между элементами информации, формулирует обоснованный вывод	
ОПК-2.3	Владеет современными методами экономического анализа, статистики и эконометрики для решения теоретических и прикладных задач	
ОПК-3 – Способен обобщать и критически оценивать научные исследования в экономике		
Методология и методы научного исследования		
ОПК-3.1	Знает достижения мировой экономической науки в	***Теоретические вопросы для проведения промежуточной аттестации:*** 1 Генезис науки, наука и научная деятельность, ее цель и задачи. 2 Функционирование науки: методологические основы и структура научной деятельности, статическая и динамическая модели

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	выбранной области научных интересов	науки. 3 Научные подходы: системный, ситуационный, проектный, программно-целевой. 4 Научные парадигмы: вклад Я. Корнаи в развитие научной методологии. 5 Научные теории и концепции как существенный элемент научной методологии. 6 Научные проблемы и гипотезы. 7 Научная трактовка понятий критериев, ограничений и методов экономических исследований. 8 Системы фундаментальных и прикладных, теоретических и экспериментальных исследований в экономике. 9 Ключевые характеристики нормативного и позитивного подхода в экономической науке. 10 Объект, предмет, цель и задачи экономической науки. 11 Приоритеты и ориентиры в экономических исследованиях. 12 Язык науки и естественный язык: методологические проблемы изучения научного языка. 13 Построение, проверка и подтверждение гипотез как основа научной методологии. ***Тестовые задания:*** 1 Виды познавательной деятельности человека: а) философское познание; б) религиозное познание; в) научное познание; г) художественное познание; д) верны все ответы. 2 Наука – это: а) деятельность по получению нового знания; б) результат деятельности по получению нового знания; в) сумма знаний, лежащих в основе научной картины мира; г) верны все ответы. 3 Фундаментальные исследования в науке – это: а) исследования, ориентированные на производство новых знаний независимо от их применения; б) исследования, ориентированные на применение новых знаний для достижения практических в) исследования, ориентированные на создание новых отраслей науки и новых направлений научных исследований; г) верны все ответы. 4 Научный подход, изучающий события реальной жизни с поддающимися проверке выводами: а) нормативный подход; б) позитивный подход; в) системный подход; г) верны все ответы. 5 Система принципов, способов организации и построения теоретической и практической деятельности, а также учение об этой системе:

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		а) концепция; б) методология; в) методика; г) парадигма; д) гипотеза; е) верны все ответы. 6 Основной вклад в развитие научной методологии внес: а) Аристотель; б) Платон; в) Сократ; г) Гегель; д) Кант; е) верны все ответы. 7 Предметом экономической науки является: а) изучение исторического процесса возникновения, развития и смены экономических концепций; б) изучение хозяйства, управления хозяйством, отношений между людьми, а также между людьми и окружающей средой, которые возникают в процессе производства, распределения, обмена, потребления продукта (услуг, благ); в) формулировка и теоретический анализ исходных гипотез; г) верны все ответы. 8 К числу научных подходов к экономических исследованиях относится: а) программно-целевой; б) ситуационный; в) системный; г) проектный; д) верны все ответы. 9 Научное предположение, выдвигаемое для объяснения какого-либо явления и требующее проверки на опыте и теоретического обоснования для того, чтобы стать достоверной научной теорией или концепцией – это: а) критерий; б) приоритет; в) альтернатива; г) гипотеза; д) ориентир; е) верны все ответы. 10 Цель экономической науки: а) изучение основных экономических течений в процессе их становления и развития; б) углубление и расширение знаний по экономической теории; в) расширение кругозора в области общих и специальных экономических наук;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		г) повышение общей и экономической культуры человека; д) верны все ответы. 11 Виды гипотез в науке: а) общие гипотезы; б) частные гипотезы; в) ad hoc – гипотезы; г) верны все ответы; д) верны ответы а) и б); е) верны ответы а) и в); ж) верны ответы б) и в). 12 Методы научных исследований: а) индукция; б) дедукция; в) абдукция; г) верны все ответы. ***Примерные индивидуальные домашние задания (ИДЗ):*** 1 Система научных исследований в экономике. 2 Закономерности и тенденции развития экономической мысли. 3 Методология как учение о системе принципов, способов организации и построения теоретической и практической деятельности. 4 Особенности формирования и применения нормативного подхода в экономической науке. 5 Особенности формирования и применения позитивного подхода в экономической науке. 6 Особенности формирования и применения системного подхода в экономической науке. 7 Научная парадигма и ее развитие в обозримой исторической ретроспективе. 8 Экономическая теория как форма научного знания, дающая целостное представление о закономерностях и существенных связях исследуемых экономических объектов, процессов и явлений. 9 Научная проблема как элементы методологии экономических исследований, ее проявления в различные исторические эпохи. 10 Основные этапы развития экономической науки и их особенности. 11 Соотношение эмпирического и теоретического уровней познания. 12 Сущность рационализма в науке. 13 Научные проблемы и проблемные ситуации в науке. 14 Верификация и фальсификация в науке. 15 Взгляды Т. Куна на понятие парадигмы научных исследований. 16 «Научное сообщество» и «Невидимый колледж» как элементы научной системы. ***Задание.*** Изучить Кодекс корпоративной этики университета и его аспекты относительно организации, проведения и практики научно-

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		исследовательской деятельности в университете. Вопросы для самоконтроля: 1. Кто автор термина «этика»: а) Эйнштейн б) Софокл в) Аристотель г) Кант д) Адорно 2. В каком году был принят манифест Рассела- йнштейна? 3. Кому принадлежат слова: «В неправильной жизни не может быть жизни правильной»: а) П. Сорокин б) Фома Аквинский в) И. Кант г) Т.Адорно 4. Кто ввел понятие «Этос науки»: а) Г.Стент б) Р. Коэн в) П. Сорокин г) Р. Мертон 5. В каком году был принят Нюрнбергский кодекс: 6. Укажите основные положения Нюрнберского кодекса: а) эксперимент должен проводиться, если есть возможность смерти или ранения; б) эксперимент нельзя прекращать ни в коем случае, так как это означает неоправданное расходование ресурсов, затраченных на проведение эксперимента; в) эксперимент не должен проводиться, если есть возможность смерти или ранения; г) условие проведения эксперимента на человеке – его добровольное согласие; д) экспериментатор должен быть готов остановить проведение эксперимента на любой стадии; 7. Какой основной документ Всемирной Федерации научных работников был принят в 1990 г.: а) «Хартия научных работников»; б) «Декларация прав и обязанностей ученых»; в) «Декларация прав научных работников»; 8. Кто из перечисленных учёных полагал, что мораль должна определять науку: а) П. Слоттердайк б) Р. Коэн в) Г. Стент г) Г. Маргенау

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		9. Основополагающие ценности, которые описывают этос науки: а) общность; б) незаинтересованность; в) организованный скептицизм; г) элитарность; д) универсализм; 10. Какие вопросы рассматривались на Пагуошской конференции в июле 1957 г.: а) опасность, вызываемая ядерным оружием в мирное и военное время; б) права научных работников; в) социальная ответственность ученых; г) контроль над ядерными вооружениями; Индивидуальные задания. Подготовьте научный доклад (научную статью) по одной из предложенных тем: «Взаимосвязь науки и этики», «История развития Всемирной ассоциации научных работников», «Плагиат в науке», «Нормативно-правовая база научной этики», «Мошенничество в науке», «Права и обязанности научных работников».
ОПК-3.2	Проводит сравнительный анализ, обобщает и критически оценивает результаты научных исследований в экономике, выявляет перспективные направления научных исследований	***Теоретические вопросы для проведения промежуточной аттестации:*** 1 Формирование новой парадигмы научно-технического развития. 2 Междисциплинарные исследования: предметно-ориентированные и проблемно-ориентированные научные исследования. 3 Научные исследования как генератор новых наукоемких технологий в условиях перехода к V и VI технологическим укладам. 4 Научные исследования как основа перехода к цифровой экономике в XXI веке. 5 Информационные общество и общество знаний: от постиндустриального к информационному обществу. 6 Дисциплинарная наука и расщепление единой картины мира. Пути восстановления единой науки. 7 Редукционизм и элевационизм как методологические принципы современных научных исследований. 8. Цифровая экономика XXI века и сущность информационного обеспечения исследований. 9. Информационные технологии как важный компонент научных исследований. Информационные технологии XXI века. Цифровая экономика. ***Практические задания для проведения промежуточной аттестации:*** Изучить Кодекс корпоративной этики университета и его аспекты относительно организации, проведения и практики научно-исследовательской деятельности в университете. ***Тестовые задания:*** 1 Какой вид исследований предполагает расчленение, разложение изучаемого объекта на отдельные элементы, составляющие части: а) индукция;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		б) дедукция; в) абдукция; г) анализ; д) синтез. 2 Какой вид исследований предполагает соединение расчлененных элементов изучаемого объекта в единое целое: а) индукция; б) дедукция; в) абдукция; г) анализ; д) синтез. 3 Основная цель экономического анализа: а) повышение эффективности функционирования предприятий; б) поиск резервов совершенствования деятельности организаций; в) укрепление благосостояния собственников организации; г) повышение устойчивости функционирования организации; д) верны все ответы. 4 Основные принципы экономического анализа: а) научность; б) системность; в) комплексность; г) объективность; д) конкретность; е) верны все ответы. 5 Средние величины, используемые в системе экономических исследований: а) простая средняя арифметическая; б) среднемесячная взвешенная; в) средняя геометрическая; г) средняя хронологическая; д) средняя гармоническая; е) все ответы верны; ж) нет правильного ответа. 6 В научных исследованиях – упрощение действительности и представление ее в абстрагированном виде с отсечением второстепенных и малозначащих деталей: а) инструментарий исследования; б) механизм исследования; в) редукция; г) моделирование;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		д) абстракция; е) нет правильного ответа. 7 Форма представления экономико-математических моделей: а) графики; б) диаграммы; в) формулы; г) таблицы; д) все ответы верны; е) нет правильного ответа. 8 Процесс образования систем единиц совокупности, однородных в каком-либо существенном отношении, а также имеющих одинаковые или близкие значения систематизирующего признака: а) индексация; б) кластеризация; в) группировка; г) агрегирование; д) нет правильного ответа. 9 Характеристики общности в стохастическом моделировании, применяемые для обработки расчетных данных: а) середина интервала; б) мода; в) медиана; г) все ответы верны. 10 Характеристики разброса значений в стохастическом моделировании, применяемые для обработки расчетных данных: а) размах вариации; б) среднее линейное отклонение; в) дисперсия; г) среднеквадратическое отклонение; д) все ответы верны. 11 Научный метод установления связи различных данных исследования и измерения ее тесноты: а) регрессионный анализ; б) корреляционный анализ; в) дисперсионный анализ; г) факторный анализ; д) кластерный анализ; е) нет правильного ответа. 12 Научный метод установления аналитического выражения стохастической зависимости между исследуемыми признаками: а) регрессионный анализ; б) корреляционный анализ;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) дисперсионный анализ; г) факторный анализ; д) кластерный анализ; е) нет правильного ответа. 13 Научный метод многомерного анализа, предназначенный для группировки совокупности данных, элементы которой характеризуются многими признаками: а) регрессионный анализ; б) корреляционный анализ; в) дисперсионный анализ; г) факторный анализ; д) кластерный анализ; е) нет правильного ответа. 14 Статистический метод, позволяющий подтвердить или опровергнуть гипотезу о том, что две выборки данных относятся к одной генеральной совокупности: а) регрессионный анализ; б) корреляционный анализ; в) дисперсионный анализ; г) факторный анализ; д) кластерный анализ; е) нет правильного ответа.
ОПК-3.3	Составляет программу научно-исследовательской работы, проводит научные исследования и представляет результаты проведенного исследования научному сообществу	***Практические задания для проведения промежуточной аттестации:*** **Задание.** Разработка понятийного аппарата проблемы и поиск решения проблемы. В соответствии с алгоритмом разработать понятийный аппарат исследования. Шаг 1. Найти и зафиксировать толкования и области применения основного понятия. Шаг 2. Указать особенности области исследования. Шаг 3. Раскрыть основное понятие, опираясь на особенности области исследования. Шаг 4. Если искомого понятия нет, следует разбить его на два компонента: ближайшее родовое понятие и понятие-уточнение. Далее принять основным понятием ближайшее родовое понятие и повторить для него шаги 1-3. Шаг 5. Найти и зафиксировать толкования и области применения понятия-уточнения. Шаг 6. Синтезировать основное понятие исследования, опираясь на свойства родового понятия и понятия- уточнения. Шаг 7. В том случае, если для ближайшего родового понятия нет определения, выделить родовую философскую категорию и повторить шаги 4-6. ***Теоретические вопросы для проведения промежуточной аттестации:*** 1 Эвристические методы и приемы анализа. Методика Форсайт-исследований. 2 Методы экспертных оценок: Дельфийский метод и метод парных корреляций. 3.Особенности формирования экспертных групп для проведения научных исследований.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		4 Методы теории игр. 5 Методы теории массового обслуживания. 6 Методы анализа ликвидности и платежеспособности организации. 7 Методы анализа финансовой устойчивости организации. 8 Инструментарий и механизм финансового анализа. 9 Методы статистики в экономических исследованиях: корреляционно-регрессионный анализ. 10 Методы статистики в экономических исследованиях: дисперсионный анализ. 11 Методы статистики в экономических исследованиях: статистика Дарбина-Уотсона. 12 Методы статистики в экономических исследованиях: кластерный анализ. ***Тестовые задания:*** 1 **Какой из перечисленных методов оценки дает представление о наиболее критических факторах проекта**: а) вероятностный метод; б) метод построения дерева решений; в) метод сценариев; г) анализ чувствительности. 2 **Какой из перечисленных методов исследования представляет собой серию численных экспериментов, призванных получить эмпирические оценки степени влияния различных факторов на некоторые зависящие от них результаты**: а) вероятностный метод; б) метод построения дерева решений; в) метод сценариев; г) анализ чувствительности. 3 Укажите основные методы оценки вероятности событий: а) статистический метод; б) аналитический метод; в) экспертный метод; г) все ответы верны. 4 Укажите тип детерминированной модели $y = \sum_{i=1}^{n} x_i = x_1 + x_2 + ... + x_n$: а) аддитивная; б) мультипликативная; в) кратная (смешанная); г) нет правильного ответа. 5 Укажите тип детерминированной модели $y = \prod_{i=1}^{n} x_i = x_1 \cdot x_2 \cdot ... \cdot x_n$:

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		а) аддитивная; б) мультипликативная; в) кратная (смешанная); г) нет правильного ответа. 6 Укажите тип детерминированной модели $y = \sum_{i=1}^{n} x_i \Big/ \sum_{j=1}^{m} x_j$: а) аддитивная; б) мультипликативная; в) кратная (смешанная); г) нет правильного ответа. 7 Укажите методы факторного анализа рисковых ситуаций: а) метод цепных подстановок; б) метод абсолютных разниц; в) метод относительных разниу; г) все ответы верны. 8 Укажите коэффициенты, характеризующие изменения относительного показателя за определенный период: а) коэффициенты динамики; б) коэффициенты структуры; в) коэффициенты эффективности; г) коэффициенты координации. 9 Укажите коэффициенты, которые исчисляются как соотношение части и целого по однородной группе изучаемых явлений и процессов: а) коэффициенты динамики; б) коэффициенты структуры; в) коэффициенты эффективности; г) коэффициенты координации. 10 Укажите коэффициенты, которые исчисляются как соотношение полученного результат деятельности и затрат: а) коэффициенты динамики; б) коэффициенты структуры; в) коэффициенты эффективности; г) коэффициенты координации. 11 Укажите название средней величины, исчисляемой по формуле $\bar{x} = \sum_{i=1}^{n} x_i \Big/ n$: а) простая средняя арифметическая; б) средняя геометрическая;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) средняя хронологическая; г) простая средняя гармоническая. 12 Укажите название средней величины, исчисляемой по формуле $\bar{x} = \left(\frac{x_1}{2} + x_2 + ... + \frac{x_n}{2}\right) \Big/ (n-1)$: а) простая средняя арифметическая; б) средняя геометрическая; в) средняя хронологическая; г) простая средняя гармоническая. 13 Укажите метод многомерного статистического анализа, предназначенный для группировки совокупности данных, элементы которой характеризуются многими признаками: а) корреляционный анализ; б) дисперсионный анализ; в) кластерный анализ; г) регрессионный анализ. 14 Укажите наименование статистического метода, позволяющего подтвердить или опровергнуть гипотезу о том, что две выборки данных относятся к одной генеральной совокупности: а) корреляционный анализ; б) дисперсионный анализ; в) кластерный анализ; г) регрессионный анализ. 15 Какой показатель ликвидности характеризуется отношением наиболее ликвидных активов к наиболее срочным и краткосрочным обязательствам компании: а) коэффициент абсолютной ликвидности; б) коэффициент критической ликвидности (промежуточный коэффициент покрытия); в) коэффициент текущей ликвидности (коэффициент покрытия); г) коэффициент общей платежеспособности; 16 Какой показатель ликвидности характеризуется отношением наиболее ликвидных и быстрореализуемых активов к наиболее срочным и краткосрочным обязательствам компании: а) коэффициент абсолютной ликвидности; б) коэффициент критической ликвидности (промежуточный коэффициент покрытия); в) коэффициент текущей ликвидности (коэффициент покрытия); г) коэффициент общей платежеспособности; 17 Какой показатель ликвидности характеризуется отношением наиболее ликвидных, быстрореализуемых и медленно реализуемых активов к наиболее срочным и краткосрочным обязательствам компании: а) коэффициент абсолютной ликвидности; б) коэффициент критической ликвидности (промежуточный коэффициент покрытия);

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) коэффициент текущей ликвидности (коэффициент покрытия); г) коэффициент общей платежеспособности; 18 Какой показатель ликвидности характеризуется отношением наиболее срочных, краткосрочных и долгосрочных обязательств к активам компании: а) коэффициент абсолютной ликвидности; б) коэффициент критической ликвидности (промежуточный коэффициент покрытия); в) коэффициент текущей ликвидности (коэффициент покрытия); г) коэффициент общей платежеспособности; 20 Что понимается под оборотным капиталом компании: а) разница между текущими активами и краткосрочными обязательствами компании; б) оборотные активы компании; в) оборотные средства компании; г) разница между итогом раздела баланса компании «Капитал и резервы» и всеми ее обязательствами. 21 Укажите основные направления оценки финансовой устойчивости современной компании: а) по соотношению собственного и заемного капитала; б) по функциональному признаку; в) по соотношению финансовых и нефинансовых активов; г) верны все ответы. 22 Какой показатель финансовой устойчивости компании рассчитывается как соотношение ее собственного капитала и активов: а) коэффициент концентрации собственного капитала; б) коэффициент финансовой зависимости; в) коэффициент устойчивого финансирования; г) коэффициент финансовой независимости капитализированных источников. 23 Какой показатель финансовой устойчивости компании рассчитывается как соотношение ее активов и собственного капитала: а) коэффициент концентрации собственного капитала; б) коэффициент финансовой зависимости; в) коэффициент устойчивого финансирования; г) коэффициент финансовой независимости.
Учебная – научно-исследовательская работа (получение первичных навыков научно-исследовательской работы)		
ОПК-3.1	Знает достижения мировой экономической науки в выбранной области научных интересов	***Практические задания:*** 1. Составление плана работы магистранта. 2. Ознакомление с тематикой научных исследований, изучение научной литературы и иных источников по исследуемой теме, определение проблемы исследования, основных подходов по теме исследования. 3. Постановка исследовательских цели, задач, определение объекта и предмета научного исследования. 4. Выбор методологии исследования.
ОПК-3.2	Проводит сравнительный анализ,	

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	обобщает и критически оценивает результаты научных исследований в экономике, выявляет перспективные направления научных исследований	5. Формирование перечня источников по выбранной теме научно-исследовательской деятельности, проведение исследований, выдвижение научных гипотез. 6. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов исследования научному сообществу. 7. Подготовка текста выпускной квалификационной квалификационной работы.
ОПК-3.3	Составляет программу научно-исследовательской работы, проводит научные исследования и представляет результаты проведенного исследования научному сообществу	
ОПК-4 – Способен принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность		
Инновационное предпринимательство		
ОПК-4.1	Выбирает и применяет методологию подготовки экономически и финансово обоснованных организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности, предложений и мероприятий по их реализации	**Перечень теоретических вопросов к зачету:** 1. Процесс принятия решений в процессе инновационного предпринимательства 2. Внешняя среда инновационного предпринимательства и ее влияние на разработку управленческих решений 3. Методы экономической оценки эффективности инновационных проектов. 4. Методы оценки рисков инновационных проектов 5. Маркетинговые решения в области инновационного предпринимательства 6.Способы коммерциализации результатов инновационной деятельно
ОПК-4.2	Разрабатывает и обосновывает	**Примерные практические задания для зачета:** 1. Инвестор имеет капитал 415 тыс. руб. На денежном рынке процентная ставка, выплачиваемая банками по депозитам, составляет

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td>альтернативные варианты организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности с учетом критериев экономической эффективности, оценки их рисков и возможных социально-экономических последствий</td><td>5,5%. Инвестору предлагается весь капитал инвестировать в инновационный проект. Экономические расчеты показывают, что в этом случае через пять лет капитал инвестора удвоится. Стоит ли инвестору вкладывать капитал в проект при условии, что доход гарантирован или лучше открыть на эту сумму депозит?
2. Компания планирует приобрести производственные цеха и расширить производство аддитивной техники. Известно, что первоначальные затраты оцениваются 172 380 450 руб. По прогнозам в течение первого года планируется дополнительно инвестировать 98 650 380 руб. Денежный поток составляет 58 129 890 руб. за год. Ликвидационная стоимость производственных цехов через 12 лет оценивается в размере 150 608 670 руб. Оцените экономическую эффективность проекта, если ставка дисконтирования составляет 12%.
3. Осуществить предварительный анализ и провести ранжирование инвестиционных проектов на основе индекса доходности для формирования инвестиционного портфеля компании, в который отбираются пять инвестиционных проектов, связанных с инновационной деятельностью. Расходы по проектам: А – 5 млн р.; Б – 3 млн р.; В – 2 млн р.; Г – 3 млн р.; Д – 2 млн р. Дисконтированные доходы по проектам соответственно: А – млн р.; Б – 4,5 млн р.; В – 4 млн р.; Г – 4,2 млн р.; Д – 3,2 млн р. Составить самый оптимальный инвестиционный портфель по индексу доходности, когда бюджет компании располагает капиталом – 10 млн р.
4. Компани собирается инвестировать 3 500 890 руб. либо в проект А, либо в проект Б. Ставка дисконтирования составляет 12%. По прогнозу недисконтированные денежные потоки от реализации проекта принесут результаты:
– Проект А позволит вернуть 55% вложенных средств в первый год его реализации и 3 150 000 руб. на следующий год, после чего будет завершен.
– Проект Б в течение трех лет сгенерирует денежные потоки: в 1-й год – 1 050 000 руб., во 2-ой год – 1 850 385 руб., в 3-тй год 2 100 000 руб.
Какой из проектов экономически более перспективен.
5. Компания занимается инвестициями в высокотехнологичные компании на стадии стартап. Перед компанией стоит выбор между 2-мя проектами «А» и «Б». Каждый проект требует вложений в сумме 120,000 долларов и имеет стоимость капитала 11%. Ожидаемые чистые денежные потоки от этих проектов представлены ниже:
<table>
<tr><td rowspan="2">Годы</td><td colspan="2">Ожидаемые чистые денежные потоки</td></tr>
<tr><td>А</td><td>Б</td></tr>
<tr><td>0</td><td>($120,000)</td><td>($120,000)</td></tr>
<tr><td>1</td><td>65,500</td><td>35,500</td></tr>
<tr><td>2</td><td>30,000</td><td>30,500</td></tr>
<tr><td>3</td><td>32,000</td><td>38,500</td></tr>
<tr><td>4</td><td>17,000</td><td>13,500</td></tr>
</table>
Рассчитайте срок окупаемости каждого проекта и внутреннюю доходность проектов. Определите наиболее перспективный.</td></tr>
<tr><td>ОПК-4.3</td><td>Разрабатывает и обосновывает альтернативные</td><td>Пример комплексного расчетно-аналитического задания:
Провести анализ альтернатив реализации инновационной стратегии бизнеса и выбрать наиболее приемлемый вариант с точки зрения получения наилучших результатов. Ответ обоснуйте. На предприятии разработана базовая стратегия - направить активы на рост</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td>варианты организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности с учетом критериев экономической эффективности, оценки их рисков и возможных социально-экономических последствий</td><td>объемов производства. Функциональная стратегия в производственной сфере - провести техническое перевооружение производственной системы с целью обеспечения роста объемов производства. Возможны три альтернативы реализации функциональной стратегической программы: 1) комплексное обновление технической базы за счет покупки нового оборудования; 2) модернизация действующего оборудования; 3) реконструкция цехов с внедрением новой технологии.
Исходные данные представлены в таблице
<table>
<tr><th rowspan="2">Цели, которые должны быть достигнуты</th><th rowspan="2">Значимость каждой цели в баллах</th><th colspan="2">Альтернатива 1</th><th colspan="2">Альтернатива 2</th><th colspan="2">Альтернатива 3</th></tr>
<tr><th>вероятность достижения цели, %</th><th>оценка</th><th>вероятность достижения цели, %</th><th>оценка</th><th>вероятность достижения цели, %</th><th>оценка</th></tr>
<tr><td>Надежность</td><td>20</td><td>20</td><td>400</td><td>10</td><td>200</td><td>40</td><td>800</td></tr>
<tr><td>Комплексность</td><td>10</td><td>30</td><td>300</td><td>40</td><td>400</td><td>10</td><td>100</td></tr>
<tr><td>Эффективность</td><td>15</td><td>60</td><td>900</td><td>40</td><td>600</td><td>20</td><td>300</td></tr>
<tr><td>Завершенность</td><td>5</td><td>20</td><td>100</td><td>50</td><td>250</td><td>30</td><td>150</td></tr>
<tr><td>Приемлемость для исполнения</td><td>50</td><td>10</td><td>500</td><td>20</td><td>1000</td><td>30</td><td>1500</td></tr>
<tr><td>Итого</td><td>100</td><td>X</td><td>2200</td><td>X</td><td>2450</td><td>X</td><td>2850</td></tr>
</table></td></tr>
<tr><td colspan="3">Корпоративная экономика</td></tr>
<tr><td>ОПК-4.1</td><td>Выбирает и применяет методологию подготовки экономически и финансово обоснованных организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности,</td><td>Перечень теоретических вопросов к экзамену:
1.Понятие корпорации в экономике.
2. Характеристика экономической среды деятельности корпораций.
3. Требования к отчетности корпорации.
4. Организационная структура корпораций.
5. Сущность и критерии корпоративного управления.
6. Пути ускорения оборачиваемости оборотных средств.
7. Управление состоянием основных фондов корпорации.
8. Сущность управления финансами.
9. Управление оборотным капиталом.
10. Оценка финансового состояния корпорации.</td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td>предложений и мероприятий по их реализации</td><td>11. Совершенствование управления финансами на предприятии.
12. Политика управления запасами.
13. Политика управления дебиторской задолженностью.
14. Процесс управления денежными средствами.
15. Инвестиционная политика.
16. Этапы формирования инвестиционной политики.
17. Стратегия и тактика инвестиционной политики.
18. Принципы инвестиционной политики.
19. Формирование инвестиционных проектов.
20. Формирование прибыли корпорации
21. Определение стоимости корпорации.
22. Показатели состояния основных средств.
23. Показатели эффективности использования оборотных средств.
24. Структура и состав оборотных средств корпорации.
25. Износ и амортизация основных средств.
26. Оценка финансового состояния корпорации.
27. Формирование инвестиционных проектов.
28. Разделы бизнес-плана.
29. Оценка эффективности инноваций.
30. Показатели бизнес-плана.</td></tr>
<tr><td>ОПК-4.2</td><td>Разрабатывает и обосновывает альтернативные варианты организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности с учетом критериев экономической эффективности, оценки их рисков и возможных социально-экономических последствий</td><td>Примерный перечень практических заданий к экзамену:
1. Оцените реальное состояние дебиторской задолженности и уровень эффективности управления дебиторской задолженностью корпорации в условиях риска и неопределенности. Выполните расчеты, результаты занесите в таблицу.
<table>
<tr><th>Классификация дебиторов по срокам возникновения задолженности, дн.</th><th>Сумма дебиторской задолженности, тыс.руб.</th><th>Удельный вес в общей сумме, %</th><th>Вероятность безнадежных долгов, %</th><th>Сумма безнадежных долгов, тыс.руб.</th><th>Реальная величина задолженности, тыс.руб.</th></tr>
<tr><td>0-30</td><td>2000,0</td><td></td><td>2,5</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>30-60</td><td>1200,0</td><td></td><td>5,0</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>60-90</td><td>1000,0</td><td></td><td>7,5</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>90-120</td><td>200,0</td><td></td><td>10,0</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>120-150</td><td>100,0</td><td></td><td>15,0</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>150-180</td><td>40,0</td><td></td><td>30,0</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>180-360</td><td>20,0</td><td></td><td>60,0</td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>свыше 360</td><td>4,0</td><td></td><td>90,0</td><td></td><td></td></tr>
</table></td></tr>
</table>

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>2. Оцените уровень эффективности проекта, предполагающего приобретение оборудования, с двухлетним сроком реализации, используя показатель NPV, если инвестиционные затраты составляют 1050,0 тыс. руб., дисконтная ставка – 12,0 %, величина чистого денежного потока за первый год – 550,0 тыс. руб. и за второй год – 680,0 тыс. руб.

3. Оцените обоснованную рыночную стоимость корпорации, используя сравнительный подход, если известно что:
- рыночная стоимость одной акции корпорации-аналога равна 113,0 руб.;
- общее количество акций корпорации-аналога, указанное в её опубликованном финансовом отчете, составляет 130000 акций;
- доли заёмного капитала оцениваемой корпорации и корпорации-аналога в стоимости совокупного финансового капитала одинаковы, а общие абсолютные размеры их задолженности составляют соответственно 5,0 и 10,0 млн. руб.;
- средняя кредитная ставка по оцениваемой корпорации в 1,5 раза больше, чем по корпорации-аналогу;
- объявленная прибыль корпорации-аналога до процентов и налогов равна 1,5 млн. руб., прибыль оцениваемой корпорации до процентов и налогов – 1,2 млн. руб.</td></tr>
<tr><td>ОПК-4.3</td><td>Принимает экономические и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности, опираясь на результаты оценки альтернативных вариантов, несет за них ответственность</td><td>Примерный перечень практических заданий к экзамену:
1. Корпорация выпустила облигации номиналом в 1000,0 руб. со сроком погашения 10 лет и ставкой купона 10,0 % годовых, выплачиваемых 1 раз в год. Объем выпуска – 100 тыс. шт., облигации были размещены по курсу 90,0% от номинала, затраты на выпуск каждой составили 50,0 руб. Кроме того, корпорация выпустила:
- привилегированные акции номиналом 750,0 руб. на общую сумму 50 000,0 тыс.руб., по которым обещан дивиденд в размере 80,0 руб. в год. Стоимость выпуска одной акции составила 50,0 руб. акции были размещены по номиналу;
- обыкновенные акции номиналом в 1000,0 руб. на общую сумму 250000,0 тыс.руб. Ожидаемый дивиденд по акции равен 100,0 руб., а темп его роста – 10,0%. Затраты на выпуск одной акции составили 85,0 руб.
Определите значение критерия эффективности организационно-управленческого решения - среднюю взвешенную стоимость капитала корпорации, сформулируйте выводы.
2. Располагая собственным капиталом в 100,0 млн.руб., корпорация решила существенно увеличить объем своей хозяйственной деятельности за счет привлечения заемного капитала. Экономическая рентабельность составляет 20,0% , минимальная ставка процента за кредит – 18,0%. Определите оптимальную (эффективную) структуру финансового капитала корпорации опираясь на критерии:
А) максимизация уровня рентабельности собственного капитала;
Б) минимизация стоимости капитала.
Решение рекомендуется представить в табличной форме.
<table>
<tr><th rowspan="2">Показатели</th><th colspan="7">Варианты расчета</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Сумма собственного капитала, млн. руб.</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Возможная сумма заемного капитала, млн. руб.</td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
</table></td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

Коэффициент финансового левериджа («плечо» рычага)								
Рентабельность активов, %								
Ставка процента за кредит без риска, %								
Премия за риск, %								
Ставка процента за кредит с учетом риска, %								

3. Определите оптимальную структуру капитала корпорации по данным, приведенным в таблице, аргументируйте.

Показатель	Варианты структуры капитала и его стоимости						
	1	2	3	4	5	6	7
Доля собственного капитала, %	100,0	90,0	80,0	70,0	60,0	50,0	40,0
Доля заемного капитала, %	0	10,0	20,0	30,0	40,0	50,0	60,0
Стоимость собственного капитала, %	13,0	13,3	14,0	15,0	17,0	19,5	25,0
Стоимость заемного капитала, %	7,0	7,0	7,1	7,5	8,0	12,0	17,0
WACC,%							

Финансовый менеджмент и корпоративные финансы (продвинутый уровень)

ОПК-4.1	Выбирает и применяет методологию подготовки экономически и финансово обоснованных организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности, предложений и	***Перечень теоретических вопросов к зачету:*** 1. Содержание, базовые принципы и цели финансового менеджмента. 2. Внешняя экономическая среда принятия финансового решения. 3. Содержание функций финансового менеджмента. 4. Базовые концепции финансового менеджмента. 5. Организационное обеспечение финансового менеджмента. 6. Сущность и методы финансового планирования в организации. 7. Методы и модели прогнозирования основных финансовых показателей. 8. Стратегическое, долгосрочное и краткосрочное финансовое планирование. Финансовая стратегия и концепция устойчивого роста. 9. Бюджеты, их виды и роль в краткосрочном планировании.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	мероприятий по их реализации	10. Концепция стоимости и структуры капитала 11. Собственные источники финансирования организации и их структура. 12. Стратегии управления собственными источниками финансирования, их преимущества и ограничения. 13. Заемные источники финансирования, их структура и характеристика. 14. Финансовая стратегия и тактика. 15. Понятие, сущность и виды финансовых активов. 16. Количественные и качественные характеристики финансовых инструментов. 17. Оценка стоимости и доходности облигаций. 18. Рынок корпоративных облигаций в России. 19. Модели и методы оценки стоимости акций. 20. Модели и методы оценки доходности акций. 21. Модели управления финансовыми рисками. 22. Портфельные стратегии, применяемые при инвестировании в финансовые активы. 23. Оценка риска и доходности портфеля. 24. Портфельная теория Марковица. 25. Алгоритм и ключевые элементы операционного анализа. Эффект операционного рычага: сущность и подходы к расчету. 26. Точка безубыточности и маржа безубыточности предприятия. 27. Операционный и финансовый рычаг. Совместный эффект рычагов. 28. Модели и методы управления основным капиталом корпорации, их преимущества и недостатки. 29. Показатели эффективности управления основным капиталом корпорации. 30. Критерии оценки эффективности инвестиций в основной капитал корпорации 31. Информационное обеспечение финансового менеджмента. 32. Финансовая отчетность в системе финансового менеджмента 33. Основные показатели учета и отчетности, используемые в финансовом менеджменте 34. Основные финансовые коэффициенты отчетности 35. Оборотный капитал предприятия: сущность, классификация и основные характеристики. Факторы, влияющие на потребность в оборотном капитале. 36. Политика управления оборотными активами: цель, типы и последствия применения. 37. Основные показатели эффективности управления оборотным капиталом. Операционный и финансовый циклы предприятия. 38. Управление денежными средствами предприятия 39. Модели управления денежными средствами (модель Баумоля и модель Миллера -Орра): суть и область применения. 40. Управление дебиторской задолженностью как часть комплексной политики управления оборотным капиталом предприятия. 41. Типы дивидендов, формы и порядок выплат 42. Дивидендная политика и стоимость организации.

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>43. Основные теории дивидендной политики.
44.Особенности дивидендной политики организаций в Российской Федерации</td></tr>
<tr><td>ОПК-4.2</td><td>Разрабатывает и обосновывает альтернативные варианты организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности с учетом критериев экономической эффективности, оценки их рисков и возможных социально-экономических последствий</td><td>

Примерные практические задания для зачета:

№1. По исходным данным составьте бюджет производства.

а) планируемый объем продаж по кварталам определен в следующем размере: 1 кварта – 1200 шт., 2 квартал – 1250 шт., 3 квартал – 1500 шт., 4 квартал – 1300 шт.

б) планируемые запасы готовой продукции на конец периода равны 15% реализации следующего периода.

в) Запас готовой продукции на конец 4 квартала составит 200 шт.

№2. По исходным данным составьте бюджет поступления денежных средств.

а) Планируемый объем продаж по квартала определен в следующем размере: 1 квартал – 3500 шт., 2 квартал – 4350 шт., 3 квартал – 5000 шт., 4 квартал – 4500 шт.

б) цена реализации составляет 2000 руб. за шт.

в) Реализованная продукция оплачивается на 80% в текущем периоде, а 20% - в следующем.

г) дебиторская задолженность за реализованную продукцию на начало 1 квартала составляет 1500 тыс. руб.

№3 Используя исходные данные двух предприятий, имеющих различную структуру капитала, определить, какое из них работает более эффективно. В таблице представлены экономические показатели предприятий.

<table>
<tr><th>Показатель</th><th>Компания А</th><th>Компания Б</th></tr>
<tr><td>Всего сумма используемого капитала, тыс. руб.</td><td>1000</td><td>2000</td></tr>
<tr><td>В том числе:
- собственный капитал, тыс. руб.
- заемный капитал, тыс. руб</td><td>
800
200</td><td>
1000
1000</td></tr>
<tr><td>Экономическая рентабельность, %</td><td>20</td><td>20</td></tr>
<tr><td>Средний процент за кредит, %</td><td>15</td><td>15</td></tr>
<tr><td>Налог на прибыль, %</td><td>20</td><td>20</td></tr>
</table>

№4. Соотношение собственного и заемного капитала у компании 50:50. При таком соотношении оно имеет прибыль до уплаты налога и процентов за кредит в размере 90 млн. руб. Проценты за кредит составляют 30 млн. руб. Величина собственного капитала 300 млн. руб. Предприятие решило увеличить в два раза размер заемного капитала, при этом экономическая рентабельность вырастет на 2%, но проценты за пользование кредитом вырастут до 15%. Определите, выгодно ли компании принятие данного решения.

</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		№5. Определите дополнительную потребность в финансировании «Mitchell Corp.», если фактический объем продаж компании равен 400 тыс. дол.; активы, возрастающие пропорционально росту объема продаж, – 120 тыс. дол.; обязательства, возрастающие пропорционально росту объема продаж, – 40 тыс. дол.; фонды, формируемые из нераспределенной прибыли, – 10 тыс. дол. Кроме того, известно, что на долю прибыли в объеме продаж приходится 10 %, норма дивиденда составляет 40 %, а объем реализации прогнозируется на уровне 480 тыс. дол. №6. Ожидаемая доходность рыночного портфеля 18%, ставка без риска 10% годовых. Коэффициент бета акции компании А относительно рыночного портфеля составляет 1,2, компании Б - 1,8, а компании В – 1,1. Цена акции А равна 15 руб., акции Б – 23 руб., акции В – 17руб. Инвестор ожидает, что через год цена акции А составит 19 руб., акции Б – 26,5 руб., акции В – 22, дивиденды по акциям не выплачиваются. Определите: а) Акции, переоценены или недооценены? б) Определите доходность личного портфеля инвестора в динамике, если в инвестиционном портфеле три акции А, две акции Б и пять акций В. 3 в) Как изменится стоимость инвестиционного портфеля, если курс акций компании А увеличится на 18%, Б – на 16%, В – упадет на 15%? Дайте рекомендации по формированию портфеля в предложенных условиях. №7. Крупный эмитент предполагает провести облигационный заем в объеме 100 млн.руб. Тираж составит 10 000 облигаций. Проведите необходимые расчета и определите вид выпускаемых облигаций, который будет наиболее выгодным для эмитента: а) десятилетние облигации с нулевым купоном и выплатой разового дохода в объеме 25 000 руб. на облигацию; б) бессрочные облигации с выплатой ежегодного дохода в объеме 1000 руб. на облигацию; в) безотзывная облигация с годовым купонным доходом 1 100 руб. и сроком обращения 5 лет. Ставка дисконтирования равна ставке рефинансирования на дату решения задачи. Сделайте аргументированный вывод №8. а)Производственная компания рассматривает проект стоимостью 10 млн дол. Срок жизни проекта составит 5 лет. Актив будет амортизироваться методом равномерных списаний. Операционный денежный поток ожидается на уровне 3,5 млн дол. в год. Корпоративный налог на прибыль составляет 20%. Безрисковая ставка доходности – 5%. Требуемая доходность акционерного капитала компании, не использующей финансовый рычаг (unlevered cost of equity), равна 20 %. Компания может получить 5-летний заем размером 7,5 млн дол. (нетто, т.е. за вычетом эмиссионных затрат) по безрисковой ставке. Эмиссионные затраты составят 1 % от валовой суммы займа (gross proceeds). Рассчитайте APV проекта. б) Предположим, что муниципальное правительство считает данный проект социально значимым и готово предоставить тот же заем, но по субсидируемой ставке в 8 %. Более того, все эмиссионные затраты правительство берет на себя. Рассчитайте APV

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

проекта.

в) Будет ли выполняться цель существования компании?

№9. Фирма приобретает технологическую линию стоимостью 300 млн. руб. Со 2-го по 8-й год ожидается отдача в виде прибыли и амортизации в размере 55 млн. руб. ежегодно. В конце 3-го года необходима модернизация стоимостью 70 тыс. руб. Ликвидационная стоимость линии к концу срока эксплуатации составит 340 тыс. руб. Норма процента – 11%. Рассчитайте NPV проекта.

№10. Объем инвестиционных возможностей предприятия ограничен 90 тыс. ден. ед. Имеется возможность выбора из следующих проектов (проекты независимы и неделимы).

Проект	Показатель, ден. ед.	
	I_0	NPV
A	30	2,82
B	20	2,56
C	50	3,21
D	10	2,68
E	20	0,91
F	40	4,51

Цена капитала – 10%. Сформируйте оптимальный портфель проектов.

№11. Компания имеет следующие показатели:
основные средства – 38667 тыс. руб.
денежные средства – 8419 тыс. руб.
дебиторская задолженность – 8853 тыс. руб.
запасы и затраты – 21380 тыс. руб.
краткосрочные кредиты и займы – 6065 тыс. руб.
долгосрочные кредиты и займы – 14750 тыс. руб.
кредиторская задолженность – 7787 тыс. руб.
Рассчитайте коэффициенты текущей, быстрой и абсолютной ликвидности.

№12. Компания имеет следующие показатели:
валюта баланса – 57273 тыс. руб.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		основные средства – 28642 тыс. руб. капитал и резервы – 38285 тыс. руб. долгосрочные обязательства – 10926 тыс. руб. запасы затраты – 15837 тыс. руб. Рассчитайте величину собственных оборотных средств, долю запасов в текущих активах, долю оборотных средств в активах. №13. Компания имеет следующие показатели: капитал и резервы – 51685 тыс. руб. валюта баланса – 77319 тыс. руб. долгосрочные обязательства 0 14750 тыс. руб. Рассчитайте коэффициенты финансовой зависимости, автономии, соотношения заемного и собственного капитала. №14. Компания имеет следующие показатели: основные средства – 28 642 тыс. руб. денежные средства – 6236 тыс. руб. дебиторская задолженность – 6558 тыс. руб. запасы и затраты – 15837 тыс. руб. краткосрочные кредиты и займы – 4486 тыс. руб. долгосрочные кредиты и займы – 10926 тыс. руб. кредиторская задолженность – 5768 тыс. руб. капитал и резервы – 38285 тыс. руб. Установите ликвидность баланса, определите излишки или недостатки средств. №15. Необходимо рассчитать текущую стоимость денежных потоков предприятия, планируемых к получению, за первый и второй год при требуемой ставке доходности 11%, если известно, что: В первый год выручка составит – 8000 тыс. руб., материальные затраты – 3600 тыс. руб., амортизационные отчисления – 800 тыс. руб., расходы на оплату труда – 2400 тыс. руб., незавершенное производство увеличится на 400 тыс. руб., дебиторская задолженность уменьшится на 100 тыс. руб., задолженность перед бюджетом уменьшится на 360 тыс. руб. Во второй год произойдут следующие изменения: предприятия получит долгосрочный кредит на сумму 900 тыс. руб., выручка возрастет на 15% по сравнению с первым годом и составит – 9200 тыс. руб., материальные затраты составят 3750 тыс. руб., собственный оборотный капитал возрастет на 540 тыс. руб. Все остальные затраты останутся на уровне предыдущего года. Ставка налога на прибыль составляет 20%. №16.Определить на основе модели Баумоля средний и максимальный размер остатков денежных средств на основе следующих данных: планируемый годовой объем денежного оборота предприятия составляет 48 млн. руб.; расходы по обслуживанию одной операции пополнения денежных средств составляют 4500 руб.; среднегодовая ставка процента по краткосрочным финансовым

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		вложениям составляет 14%. №17. Определить рентабельность оборотного капитала по чистой прибыли по следующим данным: выручка от основной реализации составила 300 тыс. руб., выручка от реализации излишков сырья – 140 тыс. руб., выручка от реализации основных средств – 110 тыс. руб., себестоимость реализованной продукции – 230 тыс. руб. управленческие и коммерческие расходы – 30 и 24 тыс. руб. соответственно, оборотные активы на начало года – 330 тыс. руб., на конец года – 510 тыс. руб. №18. Фирма имеет следующую информацию: - текущие ежегодные продажи в кредит 5000 тыс.руб., период погашения дебиторской задолженности – 3 мес., условия - net 3; норма прибыли 20%. Компания рассматривает предложение по скидкам 4/10 net 30. Ожидается, что период погашения уменьшится до 2 мес. Стоит ли реализовывать такую политику ски док? №19. Финансовые менеджеры приняли решение использовать факторинг в следующей ситуации. Продажа в кредит составляет 800 тыс.руб в год, оборачиваемость дебиторской задолженности – 2 раза. Условия факторинговой фирмы: - 25% - ный резерв дебиторской задолженности; - комиссионные – 2% на среднюю дебиторскую задолженность, подлежащие оплате при приобретении дебиторской задолженности; - 15% дебиторской задолженности после вычисления комиссионных и резерва. Проценты, подлежащие уплате, уменьшают кредит. Определить: среднюю дебиторскую задолженность, сколько получит организация при использовании факторинга.
ОПК-4.3	Принимает экономические и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности, опираясь на результаты оценки альтернативных вариантов, несет за них ответственность	***Примерный перечень задач комплексного расчетно-аналитического задания:*** №1. Компания D в настоящее время использует только акционерный капитал. Она рассматривает возможность финансовой реструктуризации, которая должна позволить привлечь заемный капитал в размере 200 млн. руб. Денежный поток компании составляет 150млн. руб. в бесконечной перспективе и до уплаты налога на прибыль. Налог на прибыль равен 20 %. Затраты на заемный капитал составляют 10 %. Затраты на акционерный капитал аналогичных компаний в отрасли, которые не используют заемного капитала в своей практике, составляют 20 %. а) Подсчитайте новую стоимость компании. б) Что произойдет со стоимостью акционерного капитала в случае реструктуризации? в) Составьте баланс компании в рыночных ценах для трех случаев, предполагая существование эффективного рынка №2. Проведите анализ финансовой среды корпорации методом SWOT- анализа. Сделайте выводы. Предложите несколько альтернатив стратегического поведения организации в соответствии с полученными результатами, выделите финансовую составляющую (отраслевая принадлежность корпорации – выбор обучающегося). №3. Финансовые риски в деятельности корпораций различных отраслей и способы их минимизации (отраслевая принадлежность корпорации – выбор обучающегося).

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		№ 4. Используя ресурсы Интернета, подготовьте характеристику корпоративного облигационного выпуска российской компании. а) Приведите данные о доходности. б) Объясните, какие данные вам необходимы, чтобы сравнить доходность выбранного вами выпуска с любым другим. №5. Используя сайт «Standard&Poor's», выберите пример кредитного рейтинга российских корпоративных облигаций. Найдите корпоративный выпуск западной компании с таким же рейтингом, присвоенным «Standard&Poor's». Объясните, в чем, на ваш взгляд, заключаются различия двух выпусков и насколько они существенны №6. Выберите наименее рискованный вариант вложения капитала, *Вариант1*. Прибыль при средней величине 30 млн. руб., колеблется от 15 млн. руб. до 40 млн. руб. Вероятность получения прибыли в 15м млн. руб. равна 0,2, а прибыли в 40 млн. руб. – 0,3. *Вариант 2*. Прибыль при средней величине 25 млн. руб. колеблется от 20 млн. руб. до 30 млн. руб. Вероятность полученя прибыли в 20 млн. руб. равна 0,4, а прибыли в 30 млн. руб. – 0,3. №7. ПАО "Ростелеком" национальная телекоммуникационная компания — крупнейший универсальный оператор связи. Миссия компании больше возможностей для людей – как через услуги, так и через реализацию проектов и инициатив, затрагивающих важные для общества темы. На основании данных отчетности определите значение коэффициента устойчивого роста, прокомментируйте полученные результаты. №8. На основе финансовой отчетности реально существующей корпорации проведите оценку финансового состояния этой корпорации. Предложите варианты совершенствования финансовой деятельности корпорации (отраслевая принадлежность корпорации – выбор обучающегося). №9.Коммуникационная компания долгое время использовала политику стабильного роста дивидендов. Каждый квартал менеджмент увеличивал дивиденды на 5 % по сравнению с дивидендом прошлого года. Однако из-за больших капиталовложений ближайшее увеличение дивиденда составит лишь 2 %. Какова будет реакция рынка? №10. Небольшая компания по производству запчастей в течение последних 4 лет выплачивала дивиденд в размере 2 дол. Компания объявляет об увеличении дивидендов до 2,3 дол. в следующем году. Рассмотрите возможные изменения цены акций. №11. Вы анализируете дивидендную политику трех компаний. Вам доступна информация о поведении цен акций в районе момента выплаты дивидендов:

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>
<table>
<tr><td rowspan="2">Цена акций</td><td colspan="3">Компания</td></tr>
<tr><td>A</td><td>B</td><td>C</td></tr>
<tr><td>Цена до выплаты</td><td>75</td><td>70</td><td>100</td></tr>
<tr><td>Цена после выплаты</td><td>72</td><td>67</td><td>95</td></tr>
<tr><td>Дивиденды на акцию</td><td>6</td><td>4</td><td>5</td></tr>
</table>
Если вы не платите налога на прибыль, какую компанию вы выберете для получения арбитражного дивидендного дохода? Опишите вашу стратегию.
</td></tr>
<tr><td colspan="3">ОПК-5 – Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач</td></tr>
<tr><td colspan="3">Эконометрика (продвинутый уровень)</td></tr>
<tr><td>ОПК-5.1</td><td>Выбирает соответствующие содержанию профессиональных задач инструментарий обработки и анализа данных, современные информационные технологии и программное обеспечение</td><td>
Перечень теоретических вопросов к зачету
1. Что означает понятие «качественная» модель регрессии?
2. В каком случае верно соотношение ?
3. Что означает высказывание «тесная линейная связь»?
4. Что показывает коэффициент детерминации равный 0,75?
5. Что такое ошибка аппроксимации?
6. Приведите пример нелинейной регрессии по включаемым в нее объясняющим переменным, но линейной по оцениваемым параметрам.
7. Что значит внутренне линейная модель?
8. Опишите, что означает высказывание «функция, наилучшим образом описывающая зависимость y от x»?

Кейс-задания, состоящие из описания ситуации и вопросов к ней
1. Определите вид функции, наилучшим образом описывающей зависимость расходов на покупку продовольственных товаров в общих расходах (%) - y от среднедневной заработной платы одного работающего (руб) – x по данным семи территорий Уральского региона за 199X г.
2. Для характеристики зависимости y от x рассчитайте параметры следующих функций:
• линейной;
• степенной;
• показательной;
• равносторонней гиперболы.
Оцените каждую модель через среднюю ошибку аппроксимации A и F-критерий Фишера.
Используйте программу Statistika
</td></tr>
<tr><td>ОПК-5.2</td><td>Использует для</td><td>Перечень вопросов для подготовки к зачету</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	решения профессиональных задач современные информационные технологии и программные средства, предварительно оценив возможность и целесообразность их использования	1. Что такое регрессионный анализ? 2. Что понимается под парной регрессией? 3. Опишите суть традиционного МНК для линейной парной регрессии. 4. Что такое «оценка параметра»? Чем отличаются «истинные» значения параметров регрессии от их оценок? 5. Что такое остатки в регрессионном анализе? 6. Опишите процедуру проверки гипотезы. 7. Что такое уровень доверия? 8. Что такое интервальный прогноз? Почему возникает необходимость построения точечных прогнозов? 9. Какой вид имеет система нормальных уравнений метода наименьших квадратов в случае линейной регрессии? 10. По какой формуле вычисляется линейный коэффициент парной корреляции? 11. Как вычисляется и что показывает индекс детерминации? 12. Как вычисляется и что показывает индекс детерминации? 13. Как проверяется значимость уравнения регрессии и отдельных коэффициентов? 14. Как строится доверительный интервал прогноза в случае линейной регрессии? 15. Как вычисляются и что показывают коэффициент эластичности Э и средний коэффициент эластичности **Кейс-задания, состоящие из описания ситуации и вопросов к неЙ** Определить факторы, формировавшие цену квартир в строящихся домах в Санкт-Петербурге в 1996 г. по данным о рынке строящегося жилья в Санкт-Петербурге (по состоянию на декабрь 1996 г.) Сгенерируйте фиктивную переменную z, отражающую местоположение квартиры и позволяющую разделить всю совокупность квартир на две группы: квартиры на севере города (Приморский район, Шувалово-Озерки, Гражданка) и на юге города (Юго-Запад, Красносельский район).Постройте уравнение регрессии, характеризующее зависимость цены от всех факторов, в линейной и степенной форме. Существует ли разница в ценах квартир, расположенных в северной и южной частях Санкт-Петербурга? Является ли наличие балкона и лоджии преимуществом квартиры на рынке? Как вы объясните этот факт?
Учебная – научно-исследовательская работа (получение первичных навыков научно-исследовательской работы)		
ОПК-5.1	Выбирает соответствующие содержанию профессиональных задач инструментарий обработки и анализа данных, современные информационные технологии и программное	**1. Практические задания:** 2. Составление плана работы магистранта. 3. Ознакомление с тематикой научных исследований, изучение научной литературы и иных источников по исследуемой теме, определение проблемы исследования, основных подходов по теме исследования. 4. Постановка исследовательских цели, задач, определение объекта и предмета научного исследования. 5. Выбор методологии исследования. 6. Формирование перечня источников по выбранной теме научно-исследовательской деятельности, проведение исследований, выдвижение научных гипотез. 7. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	обеспечение	исследования научному сообществу **8.** Подготовка текста выпускной квалификационной квалификационной работы.
ОПК-5.2	Использует для решения профессиональных задач современные информационные технологии и программные средства, предварительно оценив возможность и целесообразность их использования	***Практические задания:*** 1. Составление плана работы магистранта. 2. Ознакомление с тематикой научных исследований, изучение научной литературы и иных источников по исследуемой теме, определение проблемы исследования, основных подходов по теме исследования. 3. Постановка исследовательских цели, задач, определение объекта и предмета научного исследования. 4. Выбор методологии исследования. 5. Формирование перечня источников по выбранной теме научно-исследовательской деятельности, проведение исследований, выдвижение научных гипотез. 6. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов исследования научному сообществу **7.** Подготовка текста выпускной квалификационной квалификационной работы.
ПРОФЕССИОНАЛЬНЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ		
ПК-1 Способен проводить исследование в сфере финансовых технологий и управления рисками		
Риски использования финансовых технологий		
ПК-1.1	Проводит сравнительный анализ, обобщает и критически оценивает международный и отечественный опыт в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Финансовый рынок, его структура и роль финансовых технологий. 2. Функции мирового финансового рынка и перспективы новых технологий. 3. Риски финансовых технологий как новое явление экономики XXI века. 4. Перспективы и риски использования b2b-продуктов. 5. Перспективы и риски использования b2c-продуктов. 6. Перспективы и риски использования b2g-продуктов. 7. Перспективы и риски использования RP-технологий. 8. Перспективы и риски использования JIT-технологий. 9. Перспективы и риски использования OPT-технологий. 10. Перспективы и риски использования CRM-технологий. 11. Перспективы и риски использования роботизированных технологических комплексов. 12. Перспективы и риски использования мобильных технологий. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1. Мир-система И. Валлерстайна. Рисковые аспекты развития мировой экономики. 2. Глобальная взаимозависимость и концепция VUCA-мир. 3. Научные ресурсы глобальной экономики: роль и место финансовых технологий. 4. Научно-технический прогресс: финансовые технологии, риски и инновационные перспективы.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		5. Научно-технический прогресс: стандартизация и унификация технологий. 6. Транснациональные банки и финансовые технологии. 7. Интеграция как форма реализации и регионализации мировой экономики. 8. Механизм урегулирования внешней задолженности с использованием финансовых технологий. 9. Объективные предпосылки и классификация финансовых технологий в условиях научно-технической революции. 10. Глобальные проблемы, определяемые социально-экономическими задачами человечества, и возможности новых технологий. ***Направления исследований для экзамена:*** 1. Влияние риска на подготовку и принятие управленческих решений в условиях внедрения новых технологий. 2. Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 3. Метод аналогии в оценке риска и его применение в экономических расчетах. 4. Метод дерева решений: построение пространственно-ориентированного графа. 5. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 6. Моделирование рисков в прогнозных экономических расчетах. Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков.
ПК-1.2	Оценивает возможность использования инноваций и разработок в сфере финансовых услуг при решении практических задач в профессиональной области	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Перспективы и риски использования RP-технологий. 2. Перспективы и риски использования JIT-технологий. 3. Перспективы и риски использования OPT-технологий. 4. Перспективы и риски использования CRM-технологий. 5. Перспективы и риски использования роботизированных технологических комплексов. 6. Перспективы и риски использования мобильных технологий 7. Перспективы и риски использования биометрических технологий. 8. Перспективы и риски использования облачных технологий. 9. Перспективы и риски использования технологии распределенных реестров. 10. Перспективы и риски использования p2p-продуктов. 11. Перспективы и риски использования систем искусственного интеллекта. 12. Перспективы и риски использования многофункциональных платформ мобильных корпоративных приложений. 13. Перспективы и риски использования Big Data и систем бизнес-аналитики. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1. Концепция VUCA-мир (волатильность, неопределенность, сложность, неоднозначность) как методологическая основа управления рисками финансовых технологий. 2. Основные научно-теоретические предпосылки исследования рисков использования финансовых технологий. 3. Основные этапы накопления знаний и развития методов анализа рисков использования финансовых технологий. Идентификация

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		и оценка риска как элемент принятия решений. 4. Оценка риска использования финансовых технологий: количественный аспект. 5. Оценка риска использования финансовых технологий: качественный аспект. ***Направления исследований для экзамена:*** 1. Влияние риска на подготовку и принятие управленческих решений в условиях внедрения новых технологий. 2. Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 3. Метод аналогии в оценке риска и его применение в экономических расчетах. 4. Метод дерева решений: построение пространственно-ориентированного графа. 5. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 6. Моделирование рисков в прогнозных экономических расчетах. 7. Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков.
Рисковые аспекты глобальной экономики		
ПК-1.1	Проводит сравнительный анализ, обобщает и критически оценивает международный и отечественный опыт в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1 Причины и предпосылки формирования мировой экономики. 2 Закономерности, основные субъекты и риски развития мировой экономики. 3 Система показателей состояния и динамики мировой экономики. 4 Перспективы и риски развития мировой экономики в эпоху глобализации. 5 Школы и теории мировой экономики. Концепции зависимого развития. 6 Научно-технический прогресс, его риски и важнейшие направления в эпоху глобализации. 7 Сущность, классификации транснациональных корпораций и их функции в мировом хозяйстве. 8 Мировой рынок: понятие, сущность, характеристики, функции. 9 Риски развития важнейших региональных и национальных экономических систем современного мира. 10 Экономические циклы, модели и фазы экономических циклов. 11 Общие понятия экономических циклов: сущность, определения. 12 Причины возникновения и показатели экономического цикла. 13 Теории экономических циклов. 14 Теории экономических циклов: модель мультиплкатора-акселератора. 15 Теории экономических циклов: монетарная концепция. 16 Теории экономических циклов: эволюционная теория Й. Шумпетера, К. Фримена, С.Ю. Глазьева. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1. Мир-система И. Валлерстайна. Рисковые аспекты развития мировой экономики.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		2. Глобальная взаимозависимость и теории глобализации. 3. Научные ресурсы глобальной экономики: основные показатели. 4. Научно-технический прогресс: новые технологии, риски и ресурсосбережение. 5. Научно-технический прогресс: стандартизация и унификация. 6. Роль транснациональных корпораций на современном витке научно-технического прогресса. 7. Научно-технический прогресс и торговля. 8. Научно-технический прогресс и изменения в характере трудовых ресурсов. Конвергентное образование. 9. Транснациональные банки в мировой экономике. 10. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Дж. Китчина. 11. Виды экономических циклов по их продолжительности: К. Жугляра. 12. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы С. Кузнеца. 13. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Н.Д. Кондратьева. 14. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Форрестера. 15. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Й. Шумпетера. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы А. Тоффлера. ***Направления исследований для экзамена:*** 1. Понятие и формы международной экономической интеграции. 2. Движение капитала в мировой экономике: понятие, сущность, факторы. 3. Мировая задолженность: механизм формирования, причины, риски. 4. Экономические аспекты глобальных проблем мировой экономики. 5. Интеграция как форма реализации и регионализации мировой экономики. 6. Механизм урегулирования внешней задолженности в глобальной экономике. 7. Объективные предпосылки и классификация глобальных проблем мировой экономики в условиях научно-технической революции. 8. Глобальные проблемы, определяемые социально-экономическими задачами человечества. 9. Теории экономических циклов: теория внешних факторов У. Джевонса, теория А.Л. Чижевского. 10. Теории экономических циклов: теория промышленных циклов К. Маркса. 11. Теории экономических циклов: теория перенакопления капитала М.И. Туган-Барановского и Л. Касселя. 12. Теории экономических циклов: кредитно-денежная теория Р. Хоутри и И. Фишера. Теории экономических циклов: теория цикла Дж.М. Кейнса.
ПК-1.2	Оценивает возможность использования инноваций и разработок в сфере финансовых услуг при	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Экономические циклы, модели и фазы экономических циклов. 2. Общие понятия экономических циклов: сущность, определения. 3. Причины возникновения и показатели экономического цикла. 4. Теории экономических циклов. 5. Теории экономических циклов: модель мультиплкатора-акселератора.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	решении практических задач в профессиональной области	6. Теории экономических циклов: монетарная концепция. 7. Теории экономических циклов: эволюционная теория Й. Шумпетера, К. Фримена, С.Ю. Глазьева. 8. Сущность и структура мирового финансового рынка. 9. Функции мирового финансового рынка. 10. Участники мирового финансового рынка. 11. Инструменты мирового финансового рынка. 12. Тенденции развития мирового финансового рынка. 13. Глобализация мировой экономики: многополярный мир и поливалютная система. 14. Особенности и причины возникновения мировых финансовых кризисов. 15. Теории возникновения мировых финансовых кризисов. 16. Формы проявления и анализ последствий кризисов на сегментах мирового финансового рынка. 17. Системные риски на мировом финансовом рынке. 18. Формы проявление и анализ последствий кризисов на сегментах мирового финансового рынка. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Дж. Китчина. 2. Виды экономических циклов по их продолжительности: К. Жугляра. 3. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы С. Кузнеца. 4. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Н.Д. Кондратьева. 5. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Форрестера. 6. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Й. Шумпетера. 7. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы А. Тоффлера. 8. Экономика издержек обращения в условиях мирового финансового рынка. 9. Особенности межвременной торговли, снижающей риски и издержки экономических циклов. 10. Роль мирового финансового рынка в содействии процессов и снижении рисков непрерывного воспроизводства. 11. Система финансовых отношений: «финансовое состояние» экономики, ее секторов и субъектов экономической деятельности. 12. Особенности и риски функционирования профессиональных субъектов финансового рынка: Международный валютный фонд. 13. Особенности и риски функционирования профессиональных субъектов финансового рынка: Международный банк реконструкции и развития. 14. Особенности и риски функционирования профессиональных субъектов финансового рынка: инвестиционно-дилерские компании. 15. Особенности и риски функционирования профессиональных субъектов финансового рынка: страховые компании. 16. Теории возникновения мировых финансовых кризисов на мировом финансовом рынке. 17. Теории возникновения мировых финансовых кризисов в сфере обращения. 18. Теории возникновения мировых финансовых кризисов с позиций внешнеэкономических причин. ***Направления исследований для экзамена:***

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		1. Теории экономических циклов: теория внешних факторов У. Джевонса, теория А.Л. Чижевского. 2. Теории экономических циклов: теория промышленных циклов К. Маркса. 3. Теории экономических циклов: теория перенакопления капитала М.И. Туган-Барановского и Л. Касселя. 4. Теории экономических циклов: кредитно-денежная теория Р. Хоутри и И. Фишера. 5. Теории экономических циклов: теория цикла Дж.М. Кейнса. 6. Риски на мировом финансовом рынке: ценовой риск. 7. Риски на мировом финансовом рынке: валютный риск. 8. Риски на мировом финансовом рынке: кредитный риск. 9. Риски на мировом финансовом рынке: риск ликвидности. 10. Риски на мировом финансовом рынке: риск системного левериджа. 11. Риски на мировом финансовом рынке: риск цепной реакции. 12. Формы проявление и анализ последствий кризисов на кредитном сегменте мирового финансового рынка. 13. Формы проявление и анализ последствий кризисов на фондовом сегменте мирового финансового рынка. 14. Формы проявление и анализ последствий кризисов на валютном сегменте мирового финансового рынка. Формы проявление и анализ последствий кризисов на страховом сегменте мирового финансового рынка.
Рискология		
ПК-1.1	Проводит сравнительный анализ, обобщает и критически оценивает международный и отечественный опыт в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	***Перечень теоретических вопросов к зачету и экзамену:*** 1. Рискология и ее взаимосвязь с другими науками. 2. Методологические основы рискологии: подходы, парадигмы, теории, концепции, методы и методики. 3. Роль риска в принятии решений в сфере экономики. 4. Риск и рисковая ситуация. 5. Аксиомы и постулаты рискологии. 6. Риск как экономическая категория. Категориальный анализ риска. 7. Сущность риска как явления и квалиметрические характеристики риска. 8. Риск как случайное и закономерное явление, вероятность и возможность. 9. Неопределенность как источник риска. 10. Теория хаоса и теория бифуркаций в исследовании риска. ***Примерные практические задания для зачета и экзамена:*** ***Задача 1.*** Производитель изделия утверждает, что доля бракованных изделий не превосходит 1%. В случайной выборке объемом n = 100 оказалось 2 бракованных изделия. Оценить риск появления брака изделия, если доверительная вероятность p = 99%. ***Задача 2.*** Инвестиционный проект № 1 рассчитан на t_1 = 4 года, дисперсия ежегодной прибыли составляет s_1^2 = 15%. Инвестиционный проект № 2 рассчитан на t_2 = 3 года, дисперсия ежегодной прибыли составляет s_2^2 = 20%. Предполагается, что распределение

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		ежегодной прибыли подчиняется закону нормального распределения случайной величины. Сравнить риски инвестиционных проектов № 1 и 2 при доверительной вероятности p = 99%. ***Задача 3.*** По первой технологии для производства каждого из n_1 = 10 изделий было затрачено в среднем $\overline{X}_1$ = 30 секунд (выборочная дисперсия s_1^2 = 1 секунда). По второй технологии для производства каждого из n_2 = 16 изделий было затрачено в среднем $\overline{X}_2$ = 28 секунд (выборочная дисперсия s_2^2 = 2 секунды). Оценить риск более медленного производство по первой технологии по сравнению со второй технологией при доверительной вероятности p = 95%. ***Задача 4.*** Производитель изделия утверждает, что средний вес плитки изделия не менее α = 50 г. Риск-офицер отобрал 10 плиток изделия, вес которых составил, соответственно, 49, 50, 51, 52, 48, 47, 49, 52, 48, 51 г. Оценить риск изготовления изделия по заявленному образцу, если вес плитки изделия соответствует нормальному распределению, а доверительная вероятность составляет p = 95%. ***Направления исследований для зачета и экзамена:*** 1. Роль риска в принятии решений в сфере экономики. 2. Основные научно-теоретические предпосылки рискологии. 3. Риск и рисковая ситуация. 4. Основные этапы накопления знаний и развития науки о риске. 5. Как в исторической ретроспективе изменялись предмет и цель рискологии? 6. Что понимается под критериями, приоритетами и ориентирами в рискологии? 7. Инновационная деятельность как источник рисков. 8. Классификационная система рисков и ее методологическое значение. 9. Многолетние статистические наблюдения как основа распределения вероятности страховых случаев и актуарных расчетов. 10. Кумуляция рисков и их влияние на подготовку и принятие управленческих решений. 11. Производственно-финансовый леверидж как фактор, оказывающий мультипликативный эффект на деятельность предприятий. 12. Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 13. Метод аналогии в оценке и управлении риском и его применение для разработки сценариев действий. 14. Метод дерева решений: оценка наиболее вероятных результатов, построение пространственно-ориентированного графа. 15. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 16. Методы портфолио в исследовании рисков: методы портфельной теории, теории случайных блужданий, теории капитальных активов. 17. Моделирование рисков в прогнозных и проектных расчетах.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		18. Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков. 19.Феномен неопределенности как источника риска, неполноты или неточности информации, невозможности полного и исчерпывающего анализа всех факторов риска.
ПК-1.2	Оценивает возможность использования инноваций и разработок в сфере финансовых услуг при решении практических задач в профессиональной области	***Перечень теоретических вопросов к зачету и экзамену:*** 1. Риск как экономическая категория. Категориальный анализ риска. 2. Сущность риска как явления и квалиметрические характеристики риска. 3. Риск как случайное и закономерное явление, вероятность и возможность. 4. Неопределенность как источник риска. 5. Теория хаоса и теория бифуркаций в исследовании риска. 6. Концепции риска как теоретический и методологический источник рискологии. 7. Варианты экономических решений, обремененных риском. Альтернативы. 8. Принципы системного анализа риска в спектре экономических проблем. 9. Качественный и количественный анализ риска. 10. Использование набора показателей для количественной оценки риска. ***Примерные практические задания для зачета и экзамена:*** ***Задача 1.*** Автомат, работающий со стандартным отклонением σ = 1 г, фасует чай в пачки со средним весом α = 100 г. В случайной выборке объемом n = 25 пачек средний вес одной пачки составил $\overline{X}$ = 101,5 г. Оценить риск регулировки автомата при средней доверительной вероятности p = 95%. ***Задача 2.*** Станок, работающий со стандартным отклонением σ = 0,5 мм, производит изделия средней длины α = 20 мм. В случайной выборке объемом n = 16 изделий средняя длина одного изделия составила $\overline{X}$ = 19,8 мм. Оценить риск настройки станка, если доверительная вероятность составляет p = 99%. ***Задача 3.*** Производитель изделия утверждает, что средний вес плитки изделия не менее α = 50 г. Риск-офицер отобрал 10 плиток изделия, вес которых составил, соответственно, 49, 50, 51, 52, 48, 47, 49, 52, 48, 51 г. Оценить риск изготовления изделия по заявленному образцу, если вес плитки изделия соответствует нормальному распределению, а доверительная вероятность составляет p = 95%. ***Задача № 4.*** Используя критерии провести отбор и сформировать экспертную группу для проведения исследований

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Дельфийским методом с учетом требований к управленческим кадрам, квалификации и компетенции персонала, что позволяет предотвратить проявления вторичных рисков. Гарантией оптимизации вторичных рисков предприятия, надежности и обоснованности выводов исследований с использованием эвристических методов является правильный подбор экспертов. Группа экспертов, в зависимости от целей и задач конкретного исследования, может включать представителей различных групп взаимосвязанных специальностей, выражающих определенные концепции, мнения и суждения. Для снижения уровня вторичного риска формируется рабочая группа экспертов, которая проводит оценку какого-либо риска и для которых определяется единая процедура экспертного опроса. При формировании экспертных групп каждый эксперт, на основе персональных данных, получает квалификационную категорию δ. Общее число категорий целесообразно ограничить четырьмя категориями: $$\delta \in \{I, II, III, \Omega\}. \quad (3)$$ При этом персональные данные по каждому эксперту будут характеризоваться тремя основными параметрами: $$(e, s, t) \in E \times S \times T, \quad (4)$$ где E, S, T – множества частных квалификационных показателей и объективных сведений, по смыслу соответствующих альтернативным высказываниям; E - характеристика высшего и послевузовского образования эксперта; S - характеристика уровня научной подготовки эксперта; T - характеристика опыта работы эксперта по профилю экспертизы. Характеристика высшего и послевузовского образования эксперта: $$E = \{e_1, e_2, e_3\}; \quad (5)$$ где e_1 – базовое образование совпадает с профилем приоритетного направления; e_2 – базовое образование по смежной специальности; e_3 – базовое образование по иной специальности. Характеристика уровня научной подготовки эксперта: $$S = \{s_1, s_2, s_3\}, \quad (6)$$ где s_1 – академик РАН, член-корреспондент РАН, академик отраслевой академии, член-корреспондент отраслевой академии; s_2 – профессор, доктор наук; s_3 – кандидат наук, доцент, старший научный сотрудник. Характеристика опыта работы по профилю экспертизы: $$T = \{t_1, t_2, t_3\}, \quad (7)$$ где t_1 – опыт работы не менее десяти лет; t_2 – опыт работы не менее пяти лет; t_3 – опыт работы не менее одного года. Правило для определения квалификационной категории δ того или иного эксперта задается в виде $$E \times S \times T \to \{I, II, III, \Omega\}; \quad (8)$$

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		$$\delta = \delta(e, s, t). \quad (9)$$ Рассчитывая частные квалификационные показатели e, s, t, можно сформировать следующую функцию квалификационной категории эксперта: $$\delta = \begin{cases} I, если: \bar{e}s_1t_1 \vee e_1s_1t_2 \vee e_1s_2t_1; \\ II, если: e_1s_1t_3 \vee e_1s_2t_2 \vee e_1s_3t_1 \vee e_2s_1t_2 \vee e_2s_2t_1 \vee e_3s_1t_1; \\ III, если: e_1\bar{s}t_3 \vee e_1s_3t_2 \vee e_2s_1t_3 \vee e_2s_st_2 \vee e_3s_1t_2 \vee e_3s_2t_1; \\ \Omega, если: \bar{e}\bar{s}t_3 \vee \bar{e}s_2\bar{t} \vee e_3s_1t_3 \vee e_3s_2t_2, \end{cases} \quad (10)$$ где $\bar{e}$, $\bar{s}$, $\bar{t}$ – отрицание e, s, t, соответственно; $\vee$ – логическая дизъюнкция соответствующих трехместных конъюнкций. ***Задача № 5.*** Для выявления и систематизации рисковых факторов использовать метод Дельфи. При этом вычислительные процедуры выполняются в определенной последовательности. На практике применяется следующая последовательность основных этапов анализа методом экспертных оценок: 1. Отбираются факторы, по которым предполагается проводить оценку. 2. Определяется количество экспертов, которым предстоит проводить оценку. 3. Устанавливается балльная шкала оценок в зависимости от количества отобранных факторов; при этом меньший по значению ранг присваивается фактору, имеющему наиболее сильное влияние на изменение результативного показателя. 4. Оценки каждого эксперта вносятся в специальную таблицу, представляющую собой матрицу рангов опроса. 5. На основании полученных оценок рассчитываются суммы значений рангов по каждому фактору ($\sum x_i$) и среднее арифметическое значение суммы рангов опроса ($\bar{x}$); при этом среднее арифметическое значение суммы рангов опроса определяется делением суммы значений рангов по всем факторам на количество взятых для оценки факторов: $$\bar{x} = \frac{\sum x_i}{n}, \quad (1)$$ где n - количество факторов, отобранных для оценки. 6. Определяется разность между суммой значений рангов опроса по каждому фактору и средним арифметическим значением суммы рангов опроса, и далее рассчитываются значения квадратов этих разностей $\left(\sum x_i - \bar{x}\right)^2$. 7. По результатам вычислений определяют степень согласованности мнений экспертов $S_{\exp}$ по формуле

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

$$S_{\exp} = \frac{12 \cdot \sum_{i=1}^{n} \left(\sum x_i - \bar{x} \right)^2}{m^2 \left(n^3 - n \right)}, \qquad (2)$$

где m - число экспертов.

Далее оценивается уровень согласованности мнений экспертов на основе следующих позиций:

- неудовлетворительная степень согласованности мнений экспертов (при значениях $S_{\exp} < 0{,}3$);
- средняя степень согласованности мнений экспертов (при значениях $0{,}3 < S_{\exp} < 0{,}7$);
- высокая степень согласованности мнений экспертов (при значениях $S_{\exp} > 0{,}7$).

Выявить и систематизировать факторы, оказывающих влияние на эффективность размещения спортивной рекламы. При этом рассматриваются следующие факторы: $X1$ - место размещения рекламного средства; $X2$ - длительность размещения рекламного средства; $X3$ - уровень престижности спортивных соревнований; $X4$ - результативность (успешность) выступлений спортивной команды; $X5$ - уровень рыночной конъюнктуры рекламы. Оценки экспертов представляются в виде матрицы рангов опроса, в строках которой указываются факторы, а в столбцах – оценки экспертов.

Таблица 1 – Матрица рангов опроса экспертов

Факторы	Эксперты							$\sum x$	$\sum x_i -$	$\left(\sum x_i - \bar{x}\right)$
	1	2	3	4	5	6	7			
$X1$	1	3	2	4	5	3	3	21	0	0
$X2$	4	5	5	5	4	5	5	33	12	144
$X3$	3	2	3	1	2	2	1	1	– 7	49
$X4$	2	1	1	2	1	1	2	10	– 11	121
$X5$	5	4	4	3	3	4	4	27	6	36
Сумма	15	15	15	15	15	15	15	105	X	350

Направления исследований для зачета и экзамена:

1. Теория хаоса и теория бифуркаций в исследовании риска.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		2. Концепции риска как теоретический и методологический источник рискологии. 3. Варианты экономических решений, обремененных риском. Альтернативы. 4. Принципы системного анализа риска в спектре экономических проблем. 5. Качественный и количественный анализ риска. 6. Использование набора показателей для количественной оценки риска. 7. Анализ валютных рисков при проведении внешнеторговых и валютных кредитных операций.. 8. Анализ валютных рисков при проведении операций на фондовых и валютных биржах. 9. Неблагоприятная экономическая конъюнктура и деловой риск: анализ и прогнозирование. 10. Зоны риска и безрисковые зоны как качественные характеристики степени (уровня) риска и методологическое значение кривой Лоренца. 11. Идентификация риска: разработка перечня возможных рисковых ситуаций, прогнозирование причин и последствий (признаков) их возникновения, классификации и критерии риска. 12. Коммерческий риск производственно-хозяйственной и финансовой деятельности как результат проявления факторов валютных, политических, предпринимательских, финансовых и иных рисков. 13. Формирование критериев риска для идентификации рисковой ситуации и классификации рисков.
Стратегии и инструменты в биржевой торговле		
ПК-1.1	Проводит сравнительный анализ, обобщает и критически оценивает международный и отечественный опыт в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	***Примерные практические задания:*** Задача 1 Участник, имеющий длинную позицию по февральскому контракту на медь, решил ликвидировать свое обязательство. Что ему нужно сделать? Задача 2 Участник продал фьючерсный контракт на декабрь по нефти за 56,7 долл. за баррель (единица контракта 1000 барр.). На день, предшествующий дню выписки нотиса, котировка составила 56,2 долл. На какую сумму он выпишет счет покупателю и какова будет итоговая цена нефти для него? Задача 3 Стоимость контракта с момента его заключения упала на 3221 долл. Кто проигрывает от такого изменения стоимости контракта? Задача 4 Минимальное изменение цены контракта составляет 1/8 цента. На сколько пунктов можно изменить цену контракта? Сколько это составляет тиков? Задача 5 Цена контракта составляет 56,41 долл., единица контракта – 1000 барр.,депозит – 800 долл. Определить показатель левериджа. Задача 6 Участник фьючерсного рынка продал фьючерсный контракт на хлопок по цене 50 центов за фунт. Единица контракта – 50 тыс. фунтов. Какова будет его прибыль (убыток), если в конце срока контракта цена на фьючерс составит: а) 48,20 центов;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		б) 51,30 центов?
ПК-1.2	Оценивает возможность использования инноваций и разработок в сфере финансовых услуг при решении практических задач в профессиональной области	***Примерные задания:*** Вставьте пропущенное слово: 1 Для защиты своего урожая от падения цен фермер предполагает осуществить…… . 2 Изменение базиса от плюс 14 центов до минус 14 центов означает, что базис …… . 3 При наступлении месяца поставки происходит ……наличных и фьючерсных цен. 4 Для товаров длительного хранения стоимость хранения, страхования и оплаты банковского процента представляют…….. . 5 ……. представляет собой разницу между наличной ценой товара фьючерсной ценой этого товара. 6 На рынке финансовых инструментов издержками поставки являются…… . 7 Изменение базиса с плюс 9 центов до плюс 16 центов называется…….. . 8 Нефтеперерабатывающая компания предвидит увеличение цен на нефть в ближайшие 6 месяцев и решает осуществить …….. для будущей закупки. 9 …… представляет собой занятие позиции, противоположной позиции на наличном рынке. 10 Условие, которое делает возможным хеджирование, есть то, что наличные и фьючерсные цены движутся в целом…… . ***Примерные тестовые задания:*** 1 Хеджирование предполагает: а) занятие фьючерсной позиции, противоположной наличной рыночной позиции; б) занятие фьючерсной позиции, идентичной наличной рыночной позиции; в) наличие только фьючерсной позиции; г) наличие только наличной позиции. 2 В данный момент урожай фермера еще не собран. На наличном рынке он имеет: а) длинную позицию; б) короткую позицию; в) ни ту, ни другую, поскольку урожай не собран; г) нейтральную, поскольку у него нет позиции на фьючерсном рынке. 3 Условие, которое делает возможным хеджирование, это то, что наличные и фьючерсные цены: а) движутся в противоположном направлении; б) изменяются вверх и вниз на одну величину; в) обычно двигаются в одном направлении и примерно на одну величину; г) регулируются биржей. 4 Для хеджирования против повышения цены необходимо: а) купить фьючерсные контракты;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		б) продать фьючерсные контракты. 5 Термин базис обозначает: а) разницу между наличными ценами на разных локальных рынках; б) разницу между ценами на разные месяцы поставки; в) разницу между наличной ценой и фьючерсной ценой; г) относится только к спекуляции. 6 Если исторический базис на рынке кукурузы предполагается на уровне минус 0,15 долл., то примерная цена, которую фермер закрепил на продаваемый им товар при покупке фьючерсов по котировке 3,00 долл. за бушель, составит: а) 3,15 долл.; б) 3,10 долл.; в) 2,85 долл.; г) ни одна из этих. 7 Участник, имеющий длинную позицию на наличном рынке и не использующий хеджирование, является: а) спекулянтом; б) в положении ожидающего прибыль на росте цен; в) подвергается риску убытков при падении цен; г) все перечисленное вместе. 8 На местном рынке наличные цены обычно устанавливаются в соответствии с биржевыми котировками. Если хеджер осуществил хеджирование продажей фьючерсных контрактов, то благоприятное время для поставки наличного товара на рынок и закрытия хеджа будет: а) после начала хеджирования это безразлично; б) когда базис относительно слабый; в) когда базис относительно сильный; г) когда наличные цены находятся на высшем уровне. 9 Базисный риск обозначает: а) факт, что базис не может быть предсказан с точностью; б) абсолютный уровень фьючерсных цен; в) присущую фьючерсным ценам неустойчивость. 10 Базис равен +0,50 долл. Какая ситуация на рынке? а) нормальная; б) нестабильная; в) стабильная; г) контанго; д) бэквардейшн. 11 Несовпадение объемов реальной сделки и сделки на фьючерсном рынке называется: а) классическим хеджированием; б) селективным хеджированием;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) предвосхищающим хеджированием; г) заблаговременным хеджированием. 12 Стратегия хеджирования, при которой момент совершения операций на фьючерсном рынке не совпадает с моментом совершения реальных сделок, называется: а) классическим хеджированием; б) селективным хеджированием; в) предвосхищающим хеджированием; г) заблаговременным хеджированием. ***Примерные практические задания:*** Задача 1 На Чикагской торговой бирже по контрактам на кукурузу предусмотрены следующие месяцы поставки: март, май, июль, сентябрь и декабрь. Решите, какие позиции фьючерсов должны быть выбраны для хеджирования, если завершение хеджа планируется в: а) июне; б) июле; в) январе. Задача 2 Базис в момент начала хеджирования составлял 50 центов, в момент завершения он составил 35 центов. Кто выигрывает от такого изменения базиса? Задача 3 Российский экспортер продал 2,5 тыс. т наличного алюминия по 1110 долл. за т иностранной посреднической фирме, которая рассчитывает реализовать алюминий по 1150 долл. за тонну. В ожидании предстоящей сделки торговец решает хеджировать всю партию на ЛБМ при текущей котировке 1260 долл. за тонну (единица контракта 25 т). В течение двух недель фирме удается найти покупателя алюминия и поставить ему товар, но в условиях падения цен на рынке цена в контракте была установлена на уровне 1110 долл. за тонну. В тот период котировки ЛБМ составили 1220 долл. за тонну. Составьте таблицу и опишите действия торговой фирмы по хеджированию своей продажи, определите конечный результат
Финансовые активы и финансовые технологии		
ПК-1.1	Проводит сравнительный анализ, обобщает и критически оценивает международный и отечественный опыт в области развития,	Задачи: 1. Хозяйствующий субъект решил заключить трехмесячный срочный форвардный контракт на покупку 10 тыс. долл. США по форвардному курсу 27,20 р. за 1 долл. Следовательно, затраты на покупку валюты по контракту составили 272 тыс. р. Рассмотрим процесс хеджирования с помощью форвардной операции и определите: а) экономию денежных ресурсов или потенциальную прибыль, если через три месяца на день исполнения контракта курс спот составит до 27,80 р. за долл.; б) упущенную выгоду или потенциальные потери, если через три месяца на день исполнения контракта курс спот снизится до

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	26,80 р. за долл. 2. Имеется следующая оценка совместного вероятностного распределения доходностей от инвестиций в акции компаний А и Б: Общеэкономическая ситуация Доходность А, % Доходность Б, % Вероятность Спад - 10 0,15 Без изменения 0,20 Незначительный подъем 0,30 Существенное оживление 0,35 Вычислите ковариацию и коэффициент корреляции двух инвестиций. 3. Ожидаемая доходность акций А и Б равна соответственно 12 и 25 %. Их среднеквадратическое отклонение равно 5 и 8%. Коэффициент корреляции между доходностями акций равен 0,6. Рассчитайте ожидаемую доходность и стандартное отклонение портфеля, состоящего на 40% из акций А и на 60% из акций Б. Определите ожидаемую доходность и стандартное отклонение портфеля, состоящего на 60% из акций А и на 40% из акций Б. Сравните полученные результаты. 4. Портфель инвестора состоит из ценных бумаг со следующими характеристиками: Актив Общая рыночная стоимость, руб. Бета А 20 000 0,05 Б 4 000 0,90 С 5 000 1,10 Д 9 000 1,20 Е 2 000 1,80 Доходность безрисковых ценных бумаг равна 5%, доходность на рынке в среднем 10%. Определите бета портфеля, доходность портфеля.
ПК-1.2	Оценивает возможность использования инноваций и разработок в сфере финансовых услуг при решении практических задач в профессиональной области	**Комплексное задание по разработке проекта и его презентации (индивидуальное домашнее задание):** 1. Сегментирование потребителей розничных платежных услуг в России. 2. Построение рекомендательного сервиса в области депозитных или кредитных услуг банков и микрофинансовх организаций 3. Основные рыночные тенденции на рынке платежных услуг в России. Перспективы развития НСПК «МИР» 4. Перспективные направления развития электронных денег и криптовалют 5. Возможное влияние технологии блокчейн на платежную индустрию 6. Основные риски внедрения платежных инновационных технологий и их источники 7. Способы оценки конкурентоспособности финансовых продуктов и услуг Выведение на финансовый рынок новой платёжной услуги с использование смартфонов: план действий, риски, прогнозируемый результат и его обоснование.
Учебная - практика по получению первичных профессиональных умений и навыков		
ПК-1.1	Проводит сравнительный анализ, обобщает и критически оценивает	**Задание на практику:** – организовать библиографический поиск литературных и электронных научных, нормативно-методических и учебных источников отечественных и зарубежных авторов для уточнения темы и проблем магистерского исследования, сформулировать

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	международный и отечественный опыт в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	цели, задачи, актуальность исследуемой проблемы, научной новизны; – исследовать научную проблему и составить обзор литературных, научных и нормативно-методических источников отечественных и зарубежных авторов для написания научных статей, докладов, теоретической части выпускной квалификационной работы; – обработать информацию методами и приемами, предусмотренными в программе исследования; – сформулировать собственное мнение по проблемам исследования, выводы и предложения по совершенствованию управления рисками на исследуемом предприятии; - составить отчет по практике и подготовить его к защите
ПК-1.2	Оценивает возможность использования инноваций и разработок в сфере финансовых услуг при решении практических задач в профессиональной области	
Производственная - научно-исследовательская работа		
ПК-1.1	Проводит сравнительный анализ, обобщает и критически оценивает международный и отечественный опыт в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	**Практические задания:** 1. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов исследования научному сообществу. 2. Подготовка и оформление рукописи выпускной квалификационной работы.
ПК-1.2	Оценивает возможность использования инноваций и разработок в сфере	

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	финансовых услуг при решении практических задач в профессиональной области	
Производственная - преддипломная практика		
ПК-1.1	Проводит сравнительный анализ, обобщает и критически оценивает международный и отечественный опыт в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	**Задание на практику:** – подготовить рекомендации по развитию применяемых финансовых технологий и совершенствованию системы управления рисками (рекомендации должны быть обоснованными, т.е. сопровождаться ссылками на соответствующие нормативно-правовые акты или авторитетное мнение специалистов в сфере деятельности, исследователей, конкурентов, потребителей и т.п.); – подготовить выводы о деятельности предприятий или организаций, в области применения финансовых технологий и управления рисками, а также практические рекомендации по совершенствованию организационных и экономических аспектов их деятельности в условиях неопределенности; – систематизировать и обобщить материалы для написания выпускной квалификационной работы; – составить отчет по практике и подготовить его к защите.
ПК-1.2	Оценивает возможность использования инноваций и разработок в сфере финансовых услуг при решении практических задач в профессиональной области	
ПК-2 – Способен проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой		
Риски использования финансовых технологий		
ПК-2.1	Обосновывает актуальность, теоретическую и практическую значимость избранной	*Перечень теоретических вопросов к экзамену:* 1. Перспективы и риски использования роботизированных технологических комплексов. 2. Перспективы и риски использования мобильных технологий 3. Перспективы и риски использования биометрических технологий. 4. Перспективы и риски использования облачных технологий.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	темы научного исследования в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	5. Перспективы и риски использования технологии распределенных реестров. 6. Перспективы и риски использования p2p-продуктов. 7. Перспективы и риски использования систем искусственного интеллекта. 8. Перспективы и риски использования многофункциональных платформ мобильных корпоративных приложений. 9. Перспективы и риски использования Big Data и систем бизнес-аналитики. 10. Перспективы и риски использования MDM-системам. 11. Перспективы и риски использования VPN-сетей. 12. Перспективы и риски использования VÜIP (система связи, обеспечивающая передачу речевого сигнала по Интернету или по любым другим IP-сетям). 13. Новые медиа и глобальная информационная сеть: возможности и риски. 14. Методологическое значение концепции VUCA-мир для управления рисками экономики XXI века. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1. Влияние риска на подготовку и принятие управленческих решений в условиях внедрения новых технологий. 2. Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 3. Метод аналогии в оценке риска и его применение в экономических расчетах. 4. Метод дерева решений: построение пространственно-ориентированного графа. 5. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 6. Моделирование рисков в прогнозных экономических расчетах. 7. Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков. 8. Влияние риска на подготовку и принятие управленческих решений в условиях внедрения новых технологий. 9. Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 10. Метод аналогии в оценке риска и его применение в экономических расчетах. 11. Метод дерева решений: построение пространственно-ориентированного графа. 12. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 13. Моделирование рисков в прогнозных экономических расчетах. 14. Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков. ***Направления исследований для экзамена:*** 1. Влияние риска на подготовку и принятие управленческих решений в условиях внедрения новых технологий. 2. Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 3. Метод аналогии в оценке риска и его применение в экономических расчетах.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		4. Метод дерева решений: построение пространственно-ориентированного графа. 5. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 6. Моделирование рисков в прогнозных экономических расчетах. 7. Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков. 8. Влияние риска на подготовку и принятие управленческих решений в условиях внедрения новых технологий. 9. Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 10. Метод аналогии в оценке риска и его применение в экономических расчетах. 11. Метод дерева решений: построение пространственно-ориентированного графа. 12. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 13. Моделирование рисков в прогнозных экономических расчетах
ПК-2.2	Проводит самостоятельные научные исследования в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Финансовый рынок, его структура и роль финансовых технологий. 2. Функции мирового финансового рынка и перспективы новых технологий. 3. Риски финансовых технологий как новое явление экономики XXI века. 4. Перспективы и риски использования b2b-продуктов. 5. Перспективы и риски использования b2c-продуктов. 6. Перспективы и риски использования b2g-продуктов. 7. Перспективы и риски использования RP-технологий. 8. Перспективы и риски использования JIT-технологий. 9. Перспективы и риски использования OPT-технологий. 10. Перспективы и риски использования CRM-технологий. 11. Перспективы и риски использования роботизированных технологических комплексов. 12. Перспективы и риски использования мобильных технологий. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1. Мир-система И. Валлерстайна. Рисковые аспекты развития мировой экономики. 2. Глобальная взаимозависимость и концепция VUCA-мир. 3. Научные ресурсы глобальной экономики: роль и место финансовых технологий. 4. Научно-технический прогресс: финансовые технологии, риски и инновационные перспективы. 5. Научно-технический прогресс: стандартизация и унификация технологий. 6. Транснациональные банки и финансовые технологии. 7. Интеграция как форма реализации и регионализации мировой экономики.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		8. Механизм урегулирования внешней задолженности с использованием финансовых технологий. 9. Объективные предпосылки и классификация финансовых технологий в условиях научно-технической революции. 10. Глобальные проблемы, определяемые социально-экономическими задачами человечества, и возможности новых технологий. ***Контрольная работа № 1.*** Оценка уровня капитализации компании и выявлении факторов риска. На основе использования современных методов финансового и факторного анализа выявить ключевые факторы стратегического и тактического риска и оценить уровень капитализации промышленной компании по показателю темпа роста собственного капитала компании $q_{собств}$: $$q_{собств} = P_{об} \cdot O_{кап} \cdot M_{кап} \cdot d_{реинв} \quad (1)$$ $$q_{собств} = \frac{Пр_{реинв}}{K_{собств}} \quad (2)$$ $$P_{об} = \frac{Пр_{чист}}{O_{реал}} \quad (3)$$ $$O_{кап} = \frac{O_{реал}}{K_{общ}} \quad (4)$$ $$M_{кап} = \frac{K_{общ}}{K_{собств}} \quad (5)$$ $$d_{реинв} = \frac{Пр_{реинв}}{Пр_{чист}} \quad (6)$$ где $P_{об}$ - рентабельность оборота; $O_{кап}$ - оборачиваемость капитала; $M_{кап}$ - мультипликатор капитала; $d_{реинв}$ - доля отчислений чистой прибыли на развитие производства; $Пр_{реинв}$ - реинвестированная (капитализированная) прибыль компании, руб.; $K_{собств}$ - собственный капитал, руб.; $Пр_{чист}$ - чистая прибыль организации, руб.; $O_{реал}$ - выручка от реализации, руб.; $K_{общ}$ - общая сумма капитала организации (собственного и заемного), руб. Исходная информация для расчетов представлена в таблице 1 и характеризуют состояние активов и пассивов компании по состоянию на конец 2015 и 2016 гг. (по данным бухгалтерской отчетности компании). Таблица 1 – Исходные данные для оценки финансового состояния промышленной компании по состоянию на конец 2015 и

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

2016 гг., млн. руб.

Наименование показателей	Вариант - 1		Вариант - 2	
	2015	2016	2015	2016
ВНЕОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ				
1. Нематериальные активы	282	704	171	263
2. Основные средства	32108	39430	38022	40537
3. Незавершенное строительство	221	176	103	83
4. Доходные вложения в материальные ценности	398	542	102	146
5. Долгосрочные финансовые вложения	610	388	404	363
6. Прочие внеоборотные активы	49	80	34	72
Итого по разделу I	33668	41320	38836	41464
в т.ч. неходовые материальные ценности	31	33	28	25
ОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ				
1. Запасы:	21773	23078	23078	26006
- сырье, материалы и др. - затраты в незавершенном производстве - готовая продукция и товары для продажи - товары отгруженные - расходы будущих периодов - прочие запасы	19383 314 2029 15 26 6	20046 368 2618 12 28 6	19023 892 3100 32 27 4	21516 917 3499 34 33 7
2. НДС по приобретенным ценностям	3179	3259	3620	3872
3. Дебиторская задолженность (платежи более чем через 12 месяцев после отчетной даты)	1 055	843	522	501
в т.ч. покупатели и заказчики	–	–	–	–
4. Дебиторская задолженность (платежи в течение 12 месяцев после отчетной даты)	16377	18400	12484	14501
в т.ч. покупатели и заказчики	4410	4687	3322	2607
5. Авансы выданные	883	946	760	502
6. Прочие дебиторы	1063	1256	1022	1053
7. Краткосрочные финансовые вложения	4082	3892	1855	1925
8. Денежные средства	166	150	364	387
9. Прочие оборотные активы	–	–	–	–

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*				
		Итого по разделу II	48578	51824	43705	48747
		Итого активов	82246	93144	82541	90211
		КАПИТАЛ И РЕЗЕРВЫ				
		1. Уставный капитал	21750	21750	25550	25550
		2. Добавочный капитал	983	1050	1222	1309
		3. Резервный капитал	5834	5834	6699	6753
		4. Нераспределенная прибыль	2866	7025	6975	10336
		Итого по разделу III	31433	35659	40446	43948
		ДОЛГОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА				
		1. Займы и кредиты	14255	16810	10093	11092
		2. Прочие долгосрочные обязательства	303	450	352	288
		Итого по разделу IV	14558	17260	10445	11380
		КРАТКОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА				
		1. Займы и кредиты	21734	25629	18840	21045
		2. Кредиторская задолженность:	12937	12740	11187	12528
		- поставщики и подрядчики - задолженность перед персоналом - задолженность перед государственными внебюджетными фондами - задолженность по налогам и сборам	11711 389 109 728	11375 376 102 887	10286 333 93 475	11509 377 105 537
		3. Авансы полученные	772	990	780	593
		4. Прочие кредиторы				
		5. Задолженность перед учредителями по выплате доходов	–	–	–	–
		6. Доходы будущих периодов	812	866	843	717
		7. Резервы предстоящих расходов	–	–	–	–
		8. Прочие краткосрочные обязательства	–	–	–	–
		Итого по разделу V	36255	40225	31650	34883
		Итого пассивов	82246	93144	82541	90211
		Выручка от реализации продукции	41178	45633	40989	44878
		Чистая прибыль компании	6835	9822	9118	8327
		Величина реинвестируемой чистой прибыли	3465	3922	3198	3477

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Проанализировать полученные результаты, сделать необходимые выводы об уровне капитализации компании, темпах роста собственного капитала компании, ключевых факторах риска. Выявить изменения в финансовом состоянии промышленной компании, произошедшие в течение календарного 2015 года. Разработать рекомендации по совершенствованию финансово-хозяйственной деятельности промышленной компании и снижению уровня угроз ее бизнесу. ***Направления исследований для экзамена:*** 7. Влияние риска на подготовку и принятие управленческих решений в условиях внедрения новых технологий. 8. Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 9. Метод аналогии в оценке риска и его применение в экономических расчетах. 10. Метод дерева решений: построение пространственно-ориентированного графа. 11. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 12. Моделирование рисков в прогнозных экономических расчетах. 13. Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков.
ПК-2.3	Представляет результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи/доклада	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Перспективы и риски использования RP-технологий. 2. Перспективы и риски использования JIT-технологий. 3. Перспективы и риски использования OPT-технологий. 4. Перспективы и риски использования CRM-технологий. 5. Перспективы и риски использования роботизированных технологических комплексов. 6. Перспективы и риски использования мобильных технологий 7. Перспективы и риски использования биометрических технологий. 8. Перспективы и риски использования облачных технологий. 9. Перспективы и риски использования технологии распределенных реестров. 10. Перспективы и риски использования p2p-продуктов. 11. Перспективы и риски использования систем искусственного интеллекта. 12. Перспективы и риски использования многофункциональных платформ мобильных корпоративных приложений. 13. Перспективы и риски использования Big Data и систем бизнес-аналитики. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1. Концепция VUCA-мир (волатильность, неопределенность, сложность, неоднозначность) как методологическая основа управления рисками финансовых технологий. 2. Основные научно-теоретические предпосылки исследования рисков использования финансовых технологий.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		3. Основные этапы накопления знаний и развития методов анализа рисков использования финансовых технологий. Идентификация и оценка риска как элемент принятия решений. 4. Оценка риска использования финансовых технологий: количественный аспект. 5. Оценка риска использования финансовых технологий: качественный аспект. Фирма проводит анализ открытия нового магазина для расширения бизнеса. В случае открытия крупного магазина при благоприятной конъюнктуре рынка прогнозируется прибыль 600 млн. руб. / год, при неблагоприятной конъюнктуре – убыток 400 млн. руб. / год. В случае открытия среднего магазина при благоприятной конъюнктуре его прибыль прогнозируется на уровне 300 млн. руб. / год, при неблагоприятной конъюнктуре рынка – убыток 100 млн. руб. / год. Возможность благоприятной и неблагоприятной конъюнктуры рынка фирма оценивает одинаково. Исследования рынка экспертом обойдется фирме в 1 млн. руб. Специалист считает, что с вероятностью 0,6 конъюнктура рынка окажется благоприятной. При этом при положительном заключении эксперта конъюнктура рынка окажется благоприятной лишь с вероятностью 0,9. При его отрицательном заключении конъюнктура рынка может оказаться благоприятной с вероятностью 0,12. Использовать метод дерева решений для проверки этих вариантов. Оценить риск фирмы в случае заказа экспертного исследования рынка. Оценит риски вариантов открытия крупного и среднего магазина. Выявить стоимостную оценку наилучшего варианта решения. ***Задача № 2.*** Годовой спрос на продукцию предприятия составляет D = 1500 изделий, стоимость подачи заказа C_0 = 2000 руб./заказ, издержки хранения одной единицы изделия C_h = 4500 руб./год, время доставки 6 суток (1 год = 300 рабочих дней). Определить оптимальный размер заказа, издержки, уровень повторного заказа на основе модели управления запасами. ***Вопросы для обсуждения (на практических занятиях).*** 1 Влияние риска на подготовку и принятие управленческих решений в условиях внедрения новых технологий. 2 Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 3 Метод аналогии в оценке риска и его применение в экономических расчетах. 4 Метод дерева решений: построение пространственно-ориентированного графа. 5 Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 6 Моделирование рисков в прогнозных экономических расчетах. 7 Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков. ***Тестовые задания.*** 1 Как называются р**иски, в результате реализации которых предприятию грозит потеря прибыли**: а) катастрофические; б) критические;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) допустимые; г) верны все ответы. 2 **К какому виду риска относится разрыв контракта из-за действий властей страны, в которой находится компания-контрагент**: а) экономический; б) предпринимательский; в) политический; г) форс-мажор. 3 **Какой из видов производственного риска приводит к увеличению числа непредвиденных аварийных ситуаций**: а) использование устаревшего оборудования; б) нестабильность качества товаров и услуг; в) ненадежность составляющих технологического процесса;; г) отсутствие резервов. 4 **Какой из видов производственного риска приводит к низкой эффективности производства по сравнению с конкурентами**: а) ненадежность составляющих технологического процесса; б) нестабильность качества товаров и услуг; в) отсутствие резервов; г) появление новых технологий в отрасли. 5 **Какой из видов производственного риска приводит к увеличению затрат на ремонт и модернизацию оборудования**: а) использование устаревшего оборудования; б) появление новых технологий в отрасли; в) отсутствие резервов; г) нестабильность качества товаров и услуг. 6 **Какой из видов производственного риска приводит к невозможности покрытия пикового спроса**: а) использование устаревшего оборудования; б) выявление новых технологий в отрасли; в) отсутствие резервов; г) нестабильность качества товаров и услуг. 7 **Какой из видов производственного риска приводит к оттоку клиентов и проблемам со спросом**: а) ненадёжность составляющих производственного процесса; б) появление новых технологий в отрасли; в) нестабильность качества товаров и услуг; г) использование устаревшего оборудования. 8 **Какие из перечисленных рисков относятся к коммерческим**: а) риск, связанный неисполнением сметы инвестиционного проекта; б) риск, связанный с невозможностью покрытия пикового спроса на товар;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) риск, связанный с колебаниями процентных ставок; г) риск, связанный с транспортировкой товара. ***Задача № 3.*** По состоянию на конец финансового года внеоборотные активы компании составили 875 220 800 руб., оборотные активы – 177 604 800 руб., краткосрочные обязательства – 103 679 800 руб. Объем продаж за отчетный период составил 1 437 740 500 руб. Определить коэффициент оборачиваемости активов и оценить финансовый риск компании. ***Задача № 4.*** По состоянию на конец финансового года производственные запасы компании составили 115 478 900 руб., объем дебиторской задолженности – 46 383 400 руб., денежная наличность – 1 003 600 руб., краткосрочные обязательства – 48 055 100 руб. Оценить уровень текущей ликвидности и финансового риска компании. ***Задача № 5.*** Постоянные затраты компании составляют 2 587 120 руб., переменные затраты – 1500 руб./ед. Цена реализации продукции (без НДС) – 2500 руб./ед. Определить критическую точку производства и реализации продукции. Оценить уровень риска компании при условии реализации продукции в объеме 85 000 ед. /год. ***Направления исследований для экзамена:*** 1. Влияние риска на подготовку и принятие управленческих решений в условиях внедрения новых технологий. 2. Мера риска как необходимая для формирования альтернатив оценка риска, характеризующая возможные потери или приобретения в производственно-хозяйственной или финансовой деятельности. 3. Метод аналогии в оценке риска и его применение в экономических расчетах. 4. Метод дерева решений: построение пространственно-ориентированного графа. 5. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 6. Моделирование рисков в прогнозных экономических расчетах. 7. Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков.
Рисковые аспекты глобальной экономики		
ПК-2.1	Обосновывает актуальность, теоретическую и практическую значимость избранной темы научного исследования в области развития,	*Перечень теоретических вопросов к экзамену:* 1. Сущность и структура мирового финансового рынка. 2. Функции мирового финансового рынка. 3. Участники мирового финансового рынка. 4. Инструменты мирового финансового рынка. 5. Тенденции развития мирового финансового рынка. 6. Глобализация мировой экономики: многополярный мир и поливалютная система. 7. Особенности и причины возникновения мировых финансовых кризисов.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	8. Теории возникновения мировых финансовых кризисов. 9. Формы проявления и анализ последствий кризисов на сегментах мирового финансового рынка. 10. Системные риски на мировом финансовом рынке. 11. Формы проявление и анализ последствий кризисов на сегментах мирового финансового рынка. 12. Мировая валютная система: основные понятия и этапы формирования, проблемы и риски. 13. Европейская валютная система: формирование и регулирование. 14. Мировые валютные стандарты: Золотой стандарт и его разновидности. 15. Генуэзская валютная система и валютные блоки. 16. Бреттон-Вудская валютная система и ее кризис. 17. Ямайская валютная система и ее преимущества. 18. Валютные кризисы: сущность и классификация. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1. Экономика издержек обращения в условиях мирового финансового рынка. 2. Особенности межвременной торговли, снижающей риски и издержки экономических циклов. 3. Роль мирового финансового рынка в содействии процессов и снижении рисков непрерывного воспроизводства. 4. Система финансовых отношений: «финансовое состояние» экономики, ее секторов и субъектов экономической деятельности. 5. Особенности и риски функционирования профессиональных субъектов финансового рынка: Международный валютный фонд. 6. Особенности и риски функционирования профессиональных субъектов финансового рынка: Международный банк реконструкции и развития. 7. Особенности и риски функционирования профессиональных субъектов финансового рынка: инвестиционно-дилерские компании. 8. Особенности и риски функционирования профессиональных субъектов финансового рынка: страховые компании. 9. Теории возникновения мировых финансовых кризисов на мировом финансовом рынке. 10. Теории возникновения мировых финансовых кризисов в сфере обращения. 11. Теории возникновения мировых финансовых кризисов с позиций внешнеэкономических причин. 12. Разновидности Золотого стандарта: Золотомонетный стандарт. 13. Разновидности Золотого стандарта: Золотослитковый стандарт. 14. Разновидности Золотого стандарта: Золотодевизный стандарт. 15. Золотой стандарт в России: Золотой червонец 1923 года. 16. Валютные блоки и этапы кризиса Генуэзской валютной системы. 17. Цели создания, принципы построения и фундаментальные причины кризиса Бреттон-Вудской валютной системы. 18. Принципы устройства и механизм действия Ямайской валютной системы. ***Направления исследований для экзамена:***

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		1. Риски на мировом финансовом рынке: ценовой риск. 2. Риски на мировом финансовом рынке: валютный риск. 3. Риски на мировом финансовом рынке: кредитный риск. 4. Риски на мировом финансовом рынке: риск ликвидности. 5. Риски на мировом финансовом рынке: риск системного левериджа. 6. Риски на мировом финансовом рынке: риск цепной реакции. 7. Формы проявление и анализ последствий кризисов на кредитном сегменте мирового финансового рынка. 8. Формы проявление и анализ последствий кризисов на фондовом сегменте мирового финансового рынка. 9. Формы проявление и анализ последствий кризисов на валютном сегменте мирового финансового рынка. 10. Формы проявление и анализ последствий кризисов на страховом сегменте мирового финансового рынка. 11. Формы проявление и анализ последствий кризисов на мировом финансовом рынке: рынок золота. 12. Специальные права заимствования SDRs как инструмент мировой валютной системы. 13. Причины, особенности проявления и последствия мировых валютных кризисов. 14. Модели валютных кризисов: модель П. Кругмана. 15. Модели валютных кризисов: модель с фиксированным валютным курсом. 16. Модели валютных кризисов: модель спекулятивной атаки. 17. Модели валютных кризисов: модель с фактором уверенности. 18.Модели валютных кризисов: модель асимметрии информации
ПК-2.2	Проводит самостоятельные научные исследования в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Мировая валютная система: основные понятия и этапы формирования, проблемы и риски. 2. Европейская валютная система: формирование и регулирование. 3. Мировые валютные стандарты: Золотой стандарт и его разновидности. 4. Генуэзская валютная система и валютные блоки. 5. Бреттон-Вудская валютная система и ее кризис. 6. Ямайская валютная система и ее преимущества. 7. Валютные кризисы: сущность и классификация. 8. Причины и предпосылки формирования мировой экономики. 9. Закономерности, основные субъекты и риски развития мировой экономики. 10. Система показателей состояния и динамики мировой экономики. 11. Перспективы и риски развития мировой экономики в эпоху глобализации. 12. Школы и теории мировой экономики. Концепции зависимого развития. 13. Научно-технический прогресс, его риски и важнейшие направления в эпоху глобализации. 14. Сущность, классификации транснациональных корпораций и их функции в мировом хозяйстве. 15. Мировой рынок: понятие, сущность, характеристики, функции. 16. Риски развития важнейших региональных и национальных экономических систем современного мира. 17. Экономические циклы, модели и фазы экономических циклов. 18. Общие понятия экономических циклов: сущность, определения.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		19. Причины возникновения и показатели экономического цикла. 20. Теории экономических циклов. 21. Теории экономических циклов: модель мультиплкатора-акселератора. 22. Теории экономических циклов: монетарная концепция. 23. Теории экономических циклов: эволюционная теория Й. Шумпетера, К. Фримена, С.Ю. Глазьева. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1.Разновидности Золотого стандарта: Золотомонетный стандарт. 2.Разновидности Золотого стандарта: Золотослитковый стандарт. 3.Разновидности Золотого стандарта: Золотодевизный стандарт. 4.Золотой стандарт в России: Золотой червонец 1923 года. 5.Валютные блоки и этапы кризиса Генуэзской валютной системы. 6.Цели создания, принципы построения и фундаментальные причины кризиса Бреттон-Вудской валютной системы. 7.Принципы устройства и механизм действия Ямайской валютной системы. 8.Мир-система И. Валлерстайна. Рисковые аспекты развития мировой экономики. 9.Глобальная взаимозависимость и теории глобализации. 10. Научные ресурсы глобальной экономики: основные показатели. 11. Научно-технический прогресс: новые технологии, риски и ресурсосбережение. 12. Научно-технический прогресс: стандартизация и унификация. 13. Роль транснациональных корпораций на современном витке научно-технического прогресса. 14. Научно-технический прогресс и торговля. 15. Научно-технический прогресс и изменения в характере трудовых ресурсов. Конвергентное образование. 16. Транснациональные банки в мировой экономике. 17. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Дж. Китчина. 18. Виды экономических циклов по их продолжительности: К. Жугляра. 19. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы С. Кузнеца. 20. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Н.Д. Кондратьева. 21. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Форрестера. 22. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Й. Шумпетера. 23. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы А. Тоффлера. ***Направления исследований для экзамена:*** 1. Специальные права заимствования SDRs как инструмент мировой валютной системы. 2. Причины, особенности проявления и последствия мировых валютных кризисов. 3. Модели валютных кризисов: модель П. Кругмана. 4. Модели валютных кризисов: модель с фиксированным валютным курсом. 5. Модели валютных кризисов: модель спекулятивной атаки.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		6. Модели валютных кризисов: модель с фактором уверенности. 7. Модели валютных кризисов: модель асимметрии информации. 8. Понятие и формы международной экономической интеграции. 9. Движение капитала в мировой экономике: понятие, сущность, факторы. 10. Мировая задолженность: механизм формирования, причины, риски. 11. Экономические аспекты глобальных проблем мировой экономики. 12. Интеграция как форма реализации и регионализации мировой экономики. 13. Механизм урегулирования внешней задолженности в глобальной экономике. 14. Объективные предпосылки и классификация глобальных проблем мировой экономики в условиях научно-технической революции. 15. Глобальные проблемы, определяемые социально-экономическими задачами человечества. 16. Теории экономических циклов: теория внешних факторов У. Джевонса, теория А.Л. Чижевского. 17. Теории экономических циклов: теория промышленных циклов К. Маркса. 18. Теории экономических циклов: теория перенакопления капитала М.И. Туган-Барановского и Л. Касселя. 19. Теории экономических циклов: кредитно-денежная теория Р. Хоутри и И. Фишера. 20.Теории экономических циклов: теория цикла Дж.М. Кейнса.
ПК-2.3	Представляет результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи/доклада	***Перечень теоретических вопросов к экзамену:*** 1. Причины и предпосылки формирования мировой экономики. 2. Закономерности, основные субъекты и риски развития мировой экономики. 3. Система показателей состояния и динамики мировой экономики. 4. Перспективы и риски развития мировой экономики в эпоху глобализации. 5. Школы и теории мировой экономики. Концепции зависимого развития. 6. Научно-технический прогресс, его риски и важнейшие направления в эпоху глобализации. 7. Сущность, классификации транснациональных корпораций и их функции в мировом хозяйстве. 8. Мировой рынок: понятие, сущность, характеристики, функции. 9. Риски развития важнейших региональных и национальных экономических систем современного мира. 10. Экономические циклы, модели и фазы экономических циклов. 11. Общие понятия экономических циклов: сущность, определения. 12. Причины возникновения и показатели экономического цикла. 13. Теории экономических циклов. 14. Теории экономических циклов: модель мультиплкатора-акселератора. 15. Теории экономических циклов: монетарная концепция. 16. Теории экономических циклов: эволюционная теория Й. Шумпетера, К. Фримена, С.Ю. Глазьева. ***Примерные творческие задания для экзамена:*** 1. Мир-система И. Валлерстайна. Рисковые аспекты развития мировой экономики. 2. Глобальная взаимозависимость и теории глобализации.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		3. Научные ресурсы глобальной экономики: основные показатели. 4. Научно-технический прогресс: новые технологии, риски и ресурсосбережение. 5. Научно-технический прогресс: стандартизация и унификация. 6. Роль транснациональных корпораций на современном витке научно-технического прогресса. 7. Научно-технический прогресс и торговля. 8. Научно-технический прогресс и изменения в характере трудовых ресурсов. Конвергентное образование. 9. Транснациональные банки в мировой экономике. 10. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Дж. Китчина. 11. Виды экономических циклов по их продолжительности: К. Жугляра. 12. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы С. Кузнеца. 13. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Н.Д. Кондратьева. 14. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Форрестера. 15. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы Й. Шумпетера. 16. Виды экономических циклов по их продолжительности: циклы А. Тоффлера. ***Направления исследований для экзамена:*** 1. Понятие и формы международной экономической интеграции. 2. Движение капитала в мировой экономике: понятие, сущность, факторы. 3. Мировая задолженность: механизм формирования, причины, риски. 4. Экономические аспекты глобальных проблем мировой экономики. 5. Интеграция как форма реализации и регионализации мировой экономики. 6. Механизм урегулирования внешней задолженности в глобальной экономике. 7. Объективные предпосылки и классификация глобальных проблем мировой экономики в условиях научно-технической революции. 8. Глобальные проблемы, определяемые социально-эк ономическими задачами человечества. 9. Теории экономических циклов: теория внешних факторов У. Джевонса, теория А.Л. Чижевского. 10. Теории экономических циклов: теория промышленных циклов К. Маркса. 11. Теории экономических циклов: теория перенакопления капитала М.И. Туган-Барановского и Л. Касселя. 12. Теории экономических циклов: кредитно-денежная теория Р. Хоутри и И. Фишера. 13. Теории экономических циклов: теория цикла Дж.М. Кейнса.
Производственная - научно-исследовательская работа		
ПК-2.1	Обосновывает актуальность, теоретическую и практическую значимость избранной	

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	темы научного исследования в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	**Практические задания:** 1. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов исследования научному сообществу. 2. Подготовка и оформление рукописи выпускной квалификационной работы.
ПК-2.2	Проводит самостоятельные научные исследования в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	
ПК-2.3	Представляет результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи/доклада	
Производственная – преддипломная практика		
ПК-2.1	Обосновывает актуальность, теоретическую и практическую значимость избранной темы научного исследования в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и	**Задание на практику:** – подготовить рекомендации по развитию применяемых финансовых технологий и совершенствованию системы управления рисками (рекомендации должны быть обоснованными, т.е. сопровождаться ссылками на соответствующие нормативно-правовые акты или авторитетное мнение специалистов в сфере деятельности, исследователей, конкурентов, потребителей и т.п.); – подготовить выводы о деятельности предприятий или организаций, в области применения финансовых технологий и управления рисками, а также практические рекомендации по совершенствованию организационных и экономических аспектов их деятельности в условиях неопределенности; – систематизировать и обобщить материалы для написания выпускной квалификационной работы;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	управления рисками	
ПК-2.2	Проводит самостоятельные научные исследования в области развития, применения, регулирования финансовых технологий и управления рисками	
ПК-2.3	Представляет результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи/доклада	
ПК-3: Способен управлять процессом финансового консультирования в организации		
Современные банковские продукты и технологии		
ПК-3.1	Разрабатывает методологию финансового консультирования и финансового планирования	**Перечень теоретических вопросов к экзамену:** 1. Основные этапы зарождения и развития банков, особенности регулирования банковской деятельности на каждом этапе эволюции. 2. Экономическая и юридическая трактовка понятия «коммерческий банк», классификация коммерческих банков. 3. Банковское законодательство как основа функционирования банковской системы России. 4. Законодательные основы деятельности Центрального банка России. 5. Сущность и особенности денежно-кредитной политики (денежно-кредитного регулирования) России на текущий период. 6. Инструменты и методы денежно-кредитной политики (денежно-кредитного регулирования). 7. Сущность и особенности банковского регулировании и надзора в России на текущий период. 8. Инструменты и методы банковского регулирования и надзора. 9. Регистрация и лицензирование банковской деятельности. 10. Базельские принципы осуществления банковского регулирования и надзора. 11. Понятие и виды банковских ресурсов, регулирование их формирования и использования. 12. Бухгалтерская отчетность в системе информационного обеспечения банковского менеджмента. 13. Критерии и показатели эффективности управления банковскими ресурсами, порядок их расчета. 14. Понятие, виды и механизм реализации пассивных операций коммерческого банка. 15. Понятие и типы корреспондентских счетов коммерческих банков, порядок проведения расчетных операций по счетам

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		«ЛОРО». 16. Понятие и типы корреспондентских счетов коммерческих банков, порядок проведения расчетных операций по счетам «НОСТРО». 17. Система SWIFT, ее достоинства и недостатки. 18. Понятие, виды и механизм реализации активных операций коммерческого банка. 19. Понятие, виды кредитов, критерии их классификации. 20. Кредитная политика коммерческого банка: содержание, требования и элементы. 21. Сущность, виды и организация межбанковского кредитования. 22. «Проблемные кредиты», организация работы коммерческого банка с «проблемными кредитами». 23. Информационное обеспечение, критерии и показатели оценки кредитоспособности заемщика коммерческого банка. 24. Кредитный рейтинг заемщика и алгоритм его присвоения. 25. Критерии и показатели эффективности деятельности коммерческого банка, порядок их расчета. 26. Понятие, виды и механизм реализации активно-пассивных операций коммерческого банка. 27. Критерии и показатели эффективности осуществления банковских операций (активных, пассивных, активно-пассивных), порядок их расчета.
ПК-3.2	Формирует стандарты и внутренние регламенты по процессу финансового консультирования и финансового планирования	**Перечень практических заданий к экзамену:** №1. Коммерческий банк предоставил Н.И. Иванову кредит в размере 16 000,0 тыс. ден. ед. под 9,0% годовых на 60 месяцев с 12 марта текущего года на приобретение однокомнатной квартиры. Обеспечение по кредиту следующее: залог квартиры, поручительство жены, страхование жизни и потери трудоспособности заемщика, страхование риска уничтожения и повреждения квартиры и передача на ответственное хранение банку правоустанавливающих документов на квартиру. Определите: - документы (информационное обеспечение), которые должен потребовать коммерческий банк от заемщика при предоставлении кредита, и опишите их оформление; - счета, открытые заемщику в банке; - достаточность и ликвидность залога; - график платежей по кредиту и процентам по нему, используя формулу аннуитетов; - действия банка, если заемщик 12 марта следующего года досрочно внесет 5000,0 тыс. ден. ед. №2. Капитал коммерческого банка составляет 8,1 млн. ден. ед., а достаточность собственных средств – 5,3 %. Выясните: - на какую величину учредители должны увеличить капитал коммерческого банка, чтобы повысить надежность и соблюсти требования национальных регулирующих органов; - каковы риски коммерческого банка в случае не соблюдения им норматива достаточности собственных средств. №3. На основании следующих данных определите, соблюдается ли коммерческим банком норматив мгновенной ликвидности: касса коммерческого банка – 9000,0 тыс. ден. ед., вклады до востребования – 80000,0 тыс. ден. ед., остатки на расчетных счетах клиентов – 250000 тыс. ден. ед. Поясните: - какие санкции вправе применить Центральный банк России в отношении коммерческого банка, норматив достаточности

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>собственных средств которого не соблюдается;
- каковы риски коммерческого банка в случае не соблюдения им норматива мгновенной ликвидности.

№4. Выясните, соблюдается ли норматив достаточности собственного капитала коммерческого банка «АЛЬФА», если размер его собственного капитала составляет 180 000 тыс. ден. ед., остатки на активных счетах и степень риска составляют соответственно:
<table>
<tr><th>Активы банка</th><th>Риск, %</th></tr>
<tr><td>Касса банка – 250 тыс. ден. ед.</td><td>2,0</td></tr>
<tr><td>Средства на резервном счете Центрального банка России - 4400 тыс. ден. ед.</td><td>0,0</td></tr>
<tr><td>Средства на корреспондентском счете в Центральном банке России – 8000,0 тыс. ден. ед.</td><td>0,0</td></tr>
<tr><td>Средства на корреспондентских счетах в банках-резидентах – 12000,0 тыс. ден. ед.</td><td>50,0</td></tr>
<tr><td>Кредиты под залог государственных долговых ценных бумаг – 30000,0 тыс. ден. ед.</td><td>20,0</td></tr>
<tr><td>Ссудная задолженность физических лиц – 140000,0 тыс. ден. ед.</td><td>10,0</td></tr>
<tr><td>Кредиты банкам – резидентам России – 29500 тыс. ден. ед.</td><td>50,0</td></tr>
<tr><td>Прочие активы банка – 900 тыс. ден. ед.</td><td>100,0</td></tr>
</table>
Поясните:
- какие санкции вправе применить Центральный банк России в отношении коммерческого банка, норматив достаточности собственных средств которого не соблюдается;
- каковы риски коммерческого банка в случае не соблюдения им норматива достаточности собственных средств</td></tr>
<tr><td>ПК-3.3</td><td>Разрабатывает перспективные и текущие программы, мероприятия, схемы материально-финансового и организационного обеспечения процесса финансового консультирования</td><td>Перечень практических заданий к экзамену:
№1. Произведите плановый расчет поступлений от кредитной деятельности, используя метод оптимизации плановых решений. В базовом году они составили 150,0 тыс. ден. ед. Намечаемые мероприятия предполагают их рост на 11,0 %. Изучение конкретных условий для реализации плана показывает, что в предыдущие 5 лет темп роста этих доходов колебался от 5,0 до 10,0%, а средняя его величина составила 7,5%. Кроме того, при увеличении объема операций не учтена тенденция снижения процентных ставок по кредитам на 0,4% в год. При уточнении финансового плана необходимо составить несколько его вариантов и выбрать наиболее реальный.

№2. На начало операционного дня остаток наличных денег в оборотной кассе коммерческого банка – 35,0 млн. ден. ед. От хозяйствующих субъектов, обслуживаемых коммерческим банком в течение операционного дня, поступило 300,5 млн. ден. ед. наличных денег. В этот же день коммерческий банк выдал 200,0 млн. ден. ед. наличными. Лимит остатка оборотной кассы данного коммерческого банка – 40,0 млн. ден. ед. Рассчитайте остаток оборотной кассы на конец операционного дня и поясните, какие меры предпримет коммерческий банк с целью соблюдения норм банковского законодательства.</td></tr>
<tr><td colspan="3">Стратегии и инструменты в биржевой торговле</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
ПК-3.1	Разрабатывает методологию финансового консультирования и финансового планирования	***Перечень примерных теоретических вопросов:*** 1. Эволюция форм биржевой торговли. 2. Развитие биржевого дела на европейских биржах. 3. Крупнейшие современные биржи мира. 4. Что такое биржевая торговля и ярмарки? В чем их общность и каковы различия? 5. Как и где зарождалась биржевая торговля? 6. Каково происхождение слова «биржа»? 7. Почему часто существование биржевого рынка дополнялось неофициальным рынком? 8. Назовите крупнейшие биржи Европы в 16-19 в.в. 9. Назовите ведущие центры мировой биржевой торговли. 10. Классификация бирж. 11. Назовите и охарактеризуйте крупнейшие международные товарные биржи. 12. Возникновение первых бирж в России в 18-19 в.в. 13. Товарные биржи России в советский период. 14. Возрождение биржевой деятельности в современной России. 15. Как зарождался биржевой рынок в России? 16. Как на развитие биржевого дела в России повлияла первая мировая война? 17. Почему биржи возобновили свою деятельность в годы НЭПа? 18. Как оценивалась роль биржи в начале и в конце этого периода? 19. Условия и причины возрождения бирж в России в 1990 – 1991 г.г.? 20. Виды российских бирж? 21. Задачи и функции бирж и их подразделений. 22. Органы управления биржей. 23. Структурные подразделения биржи. 24. Каковы задачи и функции товарных бирж и их подразделений? 25. Перечислите органы управления товарными биржами. 26. Что является высшим органом управления товарной биржей? 27. Каково структурное построение товарной биржи? 28. Дайте краткую характеристику следующим комиссиям бирж: по приему членов, арбитражной, по торговой этике, по деловым операциям. 29. Каковы основные функции наблюдательного комитета, ревизионной комиссии, отдела биржевых товаров, комитета по новым ценам? 30. Каковы задачи котировальной комиссии, отдела регистрации м контроля за исполнением биржевых сделок? 31. В чем заключается основная деятельность отдела расчетов по биржевым сделкам (расчетной палаты), отдела экономического анализа? 32. Как называется место проведения биржевых торгов?

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		33. Каково назначение биржевого зала и биржевой ямы, отдела совершенствования биржевой торговли, информационно-справочного центра? 34. Правовые принципы регулирования биржевой деятельности. 35. Биржевое правовое регулирование за рубежом. 36. Правовое регулирование биржевой деятельности в России. 37. Государственное регулирование биржевой деятельности через налогообложение и саморегулирование. 38. Что понимается под биржевым законодательством? 39. Сформулируйте общее понятие регулирования биржевой деятельности. 40. Как развивался процесс регулирования мировой биржевой деятельности? Какие основные направления регулирования? 41. Какие существуют основные принципы государственного контроля за биржевой деятельностью? 42. Какие функции выполняет регулирование биржевой деятельности? 43. Как строится законодательство о товарных биржах и биржевой торговле за рубежом? 44. Как осуществляется правовое регулирование биржевой торговли в США? 45. Какова система регулирования биржевой деятельности в Великобритании? 46. Охарактеризуйте биржевое законодательство во Франции, Японии и других зарубежных государствах. 47. Как осуществлялось регулирование биржевой торговли в России до 1917 г.? 48. В чем заключалось регулирование биржевой деятельности в период нэпа? 49. Кем осуществляются государственное регулирование и контроль за деятельностью товарных бирж в Российской Федерации? 50. Какие существуют руководящие органы и основные подразделения органов государственного регулирования? 51. Как происходит процесс лицензирования бирж? 52. В чем суть государственного регулирования биржевой деятельности через налогообложение и саморегулирование? 53. Участники биржевых торгов. 54. Торговый процесс в биржевом операционном зале. 55. Биржевой товар. 56. Порядок ведения торгов, снятия товара с торгов. 57. Биржевой язык жестов и биржевой жаргон. 58. Кто является участником биржевых торгов? 59. Кто относится к служащим биржи? 60. Как называются лица, ведущие торги на товарной бирже? 61. Кто такие посетители биржевых торгов? 62. Как называется место проведения биржевых торгов? 63. Могут ли товарные биржи заключать сделки за свой счет? 64. Что понимается под биржевым товаром? 65. Какие группы и подгруппы относятся к биржевым товарам? 66. Чем отличается биржевой стандарт от национального? 67. Что понимается под варрантом? 68. Является ли варрант биржевым товаром?

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		69. В чем заключается порядок ведения торгов? 70. Каков порядок снятия товаров с торгов? 71. Что представляет собой биржевой язык жестов? 72. Дайте определение биржевому жаргону. 73. Виды биржевых сделок. 74. Биржевые и внебиржевые опционы. 75. Спекулятивные сделки. 76. Виды цен при сделках. 77. Регистрация и оформление сделок. 78. Что понимается под биржевой сделкой? Какие виды сделок существуют? 79. Перечислите виды и цели хеджирования. 80. Каково назначение опционов? 81. Какие виды опционов вы знаете? 82. Охарактеризуйте спекулятивные сделки. 83. Какие виды цен вы знаете в биржевой торговле? 84. Раскройте понятие «котировка цен биржевых товаров». 85. Как происходит регистрация сделок? 86. В чем заключается суть оформления сделок? 87. Охарактеризуйте порядок расторжения сделок. 88. Какие виды санкций применяют к нарушителям правил биржевой торговли? 89. Место и роль брокерской службы на биржах. 90. Организационная структура брокерских фирм. 91. Роль вознаграждения за брокерский труд. 92. Раскройте роль брокерских служб на биржах. 93. Каковы задачи брокерской фирмы? 94. Изложите функции брокерской фирмы. 95. Какие преимущества имеют клиенты, прибегающие к услугам брокерской фирмы? 96. Кем осуществляется брокерская деятельность на международных биржевых рынка? 97. Какова структура брокерских фирм? 98. Назовите систему оплаты за брокерский труд. 99. Товарная биржа как элемент рынка. 100. Классификация товарных бирж. 101. Виды сделок на товарной бирже. 102. Что представляет собой биржа как элемент рынка? 103. Какова роль биржи в системе рынка? 104. Изложите основные черты, характеризующие классификацию товарных бирж. 105. Раскройте классификационную структуру товарных бирж.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		106. Дайте краткую характеристику основным классификационным группам товарных бирж: по организационно-правовому статусу, по характеру деятельности, по масштабу действия, по степени участия посетителей, по характеру биржевых операций. 107. Рынок ценных бумаг. 108. Первичный фондовый рынок. 109. Вторичный фондовый рынок. 110. Деятельность фондовых бирж. 111. Определение курса ценных бумаг. 112. Фондовые биржи в России. 113. Что входит в понятие «рынок ценных бумаг»? 114. Что понимается под ценной бумагой? 115. Какие типы рынков ценных бумаг вы знаете? 116. Кто такой эмитент? 117. Что понимается под первичным фондовым рынком? 118. Что входит в понятие «вторичный фондовый рынок»? 119. Что понимается под фондовой биржей? 120. В чем заключается деятельность фондовых бирж? 121. Как определяется курс ценных бумаг? 122. В чем состоит основное отличие фондовой от товарной биржи? 123. Как называются лица, ведущие торги на фондовой бирже? 124. Какие ценные бумаги относятся к основным фондовым ценностям? 125. Что называется курсом ценных бумаг? 126. Каким образом на фондовых биржах выставляются ценные бумаги на торги? 127. Валютный рынок. 128. Валютные биржи за рубежом. 129. Национальный валютный рынок. 130. Виды валютных сделок. 131. Порядок заключения сделок на валютной бирже. 132. Раскройте сущность международной валютной системы. 133. Каково значение валютных бирж на международной арене? 134. Что такое валютный курс? 135. Что входит в понятие валютной сделки? 136. Какие вы знаете виды валютных сделок? 137. Дайте определение кассовым сделкам. 138. Характеристика фьючерсной биржи. 139. Механизмы биржевой фьючерсной торговли. 140. Фьючерсный рынок в Российской Федерации. 141. Дайте определение фьючерсной бирже.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		142. В чем отличие фьючерсной биржи от биржи реального товара? 143. Изложите функции фьючерских бирж. 144. В чем заключается особенность функций фьючерских бирж? 145. Какие группы рабочих органов бирж осуществляют обслуживание клиентуры? 146. Когда возник фьючерский рынок в Российской Федерации? 147. В чем заключаются особенности функционирования фьючерсного рынка в России? 148. Основные фонды и оборотные средства бирж. 149. Товарные запасы биржевых складов. 150. Кадры для биржевой деятельности. 151. Что понимается под основными фондами бирж? 152. Что понимается под оборотными средствами бирж? 153. Дайте краткую характеристику оборотным фондам бирж. 154. Что понимается под фондами обращения? 155. Из чего образуются оборотные средства бирж? 156. Дайте определение нормируемым и ненормируемым оборотным средствам. 157. Раскройте содержание товарных запасов и цель их накопления на биржевых складах. 158. Что понимается под методом управления запасами на биржевых складах? ***Примерные кейсовые задания:*** Кейс 1 Вы владеете значительным пакетом акций крупного российского предприятия, являющегося практически монополистом в своей отрасли. Вы хотели бы, с одной стороны, приобрести еще акции этого предприятия, а с другой стороны, заработать на уже имеющихся. В настоящий момент уже две недели на данном предприятии одним из государственных органов с контрольно-фискальными функциями проводится закрытая проверка. На бирже поползли слухи о выявленных этим органом нарушениях на предприятии. Однако Вам совершено случайно удалось доподлинно узнать, что на самом деле никаких нарушений проверка до сих пор не выявила. Предполагается, что проверка будет проходить еще, как минимум, неделю. Опишите биржевую стратегию на ближайшую неделю и составьте биржевые приказы, которые Вы отдадите Вашему брокеру на бирже сейчас, чтобы получить прибыль от операций со старыми акциями и получить новые. Кейс 2 Клиент открывает счет в брокерской фирме с депозитом 125000 рублей. В начале текущего месяца клиент покупает 2 фьючерсных контракта на доллары США по цене 32,04 руб./долл., 2 фьючерсных контракта на евро по цене 32,40 руб./евро и 3 фьючерса на японские иены по цене 0,2050 руб./иена. Объемы контрактов соответственно: 10000 долларов, 10000 евро и 1 млн иен. Срок исполнения по всем контрактам наступает через три месяца.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Биржа осуществляет торги по данным контрактам с минимальной поддерживающей маржой, которая составляет 80% от первоначальной. Ставка первоначальной маржи для данных контрактов установлена биржей в 10%. В конце месяца клиент продал оба долларовых контракта по 31,86 руб./долл. В этот же день евро-фьючерсы на бирже выросли до 32,55 руб./евро, а фьючерсы на иены упали в цене. До какой цены упали фьючерсы на иены, если брокерская фирма направила клиенту требование о пополнении маржи на сумму 29460 рублей? Комиссионные брокеру и регистрационный сбор за совершение сделки не учитывать. Кейс 3. Промышленному предприятию 11 января текущего года в оплату за предоставленные услуги должник выписал вексель А сроком платежа по предъявлении. По данному векселю А предусмотрено начисление процентов из расчета 18% годовых. 12 мая текущего года предприятие за поставку товаров получило с дисконтом 20% вексель В, срок платежа по которому наступает 12 октября того же года. 12 июля предприятие, нуждаясь в деньгах, учло вексель В в банке и предъявило к оплате вексель А (который был немедленно и в полном объеме оплачен плательщиком). По какому векселю предприятие получило большую доходность? Учесть налогообложение. Банковскую учетную ставку принять равной 28% годовых.
ПК-3.2	Формирует стандарты и внутренние регламенты по процессу финансового консультирования и финансового планирования	***Примерные практические задания:*** Задача 1 Клиент продал 20 январских фьючерсных контрактов на нефть по 14,5 долл./бар. (единица контракта - 1000 баррелей; депозит - 1000 долл.), внеся облигации Казначейства США на сумму 50 тыс. долл. Цена нефти поднялась до 15,2 долл.: а) есть ли необходимость вносить переменную маржу? б) может ли клиент открыть дополнительные позиции с таким депозитом? в) сколько дополнительных позиций он может открыть? Задача 2 Предположим, вы имеете короткую фьючерсную позицию по июльским контрактам на серебро по 5,20 долл./унц. на НАЙМЕКС. Единица контракта составляет 5000 унций, первоначальная маржа равна 4 тыс. долл., а поддерживающая маржа составляет 3 тыс. долл.: а) рассчитайте, какое изменение в ценах на серебро приведет к появлению требования о внесении вариационной маржи; б) что будет, если вариационная маржа не будет внесена? Задача 3 Компания имеет короткую позицию на 5 тыс. бушелей пшеницы по 250 центов за бушель. Первоначальная маржа составляет 3 тыс. долл., поддерживающая маржа - 2 тыс. долл. При каких обстоятельствах со счета будет списана сумма в 1500 долл.? Задача 4 В конце дня у клиринговой фирмы имеется длинная позиция в 100 контрактов, а расчетная стоимость контракта составляет 50

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		тыс. долл. Первоначальная маржа составляет 2 тыс. долл. за контракт. На следующий день у фирмы добавляются 20 длинных позиций, открытых при стоимости контракта в 51 тыс. долл. Расчетная стоимость в конце этого дня составила 50 200 долл. Какую сумму должна внести клиринговая фирма в расчетную палату? Задача 5 Клиент купил 25 январских фьючерсных контрактов на медь по 1700 долл. за т (депозит — 2500 долл. за контракт, единица контракта — 25 т), переведя 20 тыс. долл. на свой счет у брокера в дополнение к находящимся там векселям Казначейства США на сумму 100 тыс. долл. Цены на медь упали до 1600 долл.: а) есть ли необходимость для клиента вносить переменную маржу и сколько? б) может ли клиент открыть дополнительные позиции под то же самое обеспечение? Если да, то сколько позиций? Задача 6 Клиент купил 20 фьючерсных контрактов на олово по цене 6215 долл. за тонну (единица контракта — 5 т, депозит — 2000 долл. за контракт), переведя на свой счет у брокера 10 тыс. долл. США в дополнение к имеющемуся там складскому свидетельству на сумму 50 тыс. долл. Цена олова упала до 6100 долл.: а) есть ли необходимость для клиента вносить переменную маржу и сколько? б) может ли клиент открыть дополнительные позиции под то же самое обеспечение? Если да, то сколько позиций?
ПК-3.3	Разрабатывает перспективные и текущие программы, мероприятия, схемы материально-финансового и организационного обеспечения процесса финансового консультирования	***Примерные практические задания:*** Задание 1. Хеджирование экспортно-импортных сделок. Фирма РФ ведет переговоры 15 апреля о закупке партии японских часов с одной из фирм в Японии. Требование японской фирмы: платеж должен быть осуществлен в иенах по поставке партии часов. Поставка состоится через семь месяцев. Цена 2850 иен/ед. Размер партии 15000 ед. Покупатель должен осуществить через семь месяцев платеж в сумме 42750000 иен. Курсы обмена доллара на иены по состоянию на 15 апреля (USD/JPY): Наличный обменный курс - 0,004173 Июньский - 0,004200 Сентябрьский фьючерсный контракт - 0,004237 Декабрьский- 0,004265 Партия часов прибывает 18 ноября. Вопрос: Описать процедуру хеджирования сделки путем проведения операции с валютными фьючерсными контрактами, ответив на следующие вопросы: -С какими трудностями сталкивается импортер при осуществлении хеджирования? -С каким количеством фьючерсных контрактов импортер будет проводить хеджирование и почему? -На какую сумму у импортера останется незащищенный хеджем валютный риск?

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		-Какова общая сумма потерь импортера при осуществлении операции хеджирования? -По каким причинам хедж был эффективен всего лишь частично? Задание 2. Изложите классический способ покрытия валютного риска на срочном валютном рынке: а) импортер покупает ту валюту на срочном валютном рынке на срок, которую он должен поставщику; б) экспортер продает на срочном валютном рынке ту валюту, которую он предполагает получить от своего иностранного покупателя. Как Вы понимаете выражение: а) импортер покрывает свою короткую валютную позицию длинной позицией на валютном рынке; в) экспортер обеспечивает покрытие своей длинной валютной позиции короткой на валютном рынке. Задание 3. Предположим, что курс доллара к евро и к иене подвержен изменениям в равной степени. Но при этом евро неожиданно стремится к своему обесценению относительно доллара, когда доходность остальных ваших активов внезапно возрастает, в то время как иена в тех же условиях демонстрирует резкое повышение своего курса относительно доллара. Вопрос: -Какая валюта, иена или евро, будет более рискованной в этих условиях, с точки зрения резидента США, России? -Примените портфельный подход. Задание 4. Иногда выдвигается обвинение, что некоторые страны произвольно повышают активное сальдо текущего счета посредством удерживания своей валюты на слишком низком уровне, то есть вмешательство центрального банка на валютный рынок поддерживает валюту на уровне ниже равновесного курса, определяемого свободным рынком. Вопрос: -Как такое поведение повлияло бы на экспорт и импорт страны? -Какое предположение делается относительно эластичности спроса при выдвижении обвинения в произвольном повышении активного сальдо? Объясните подробно.
Финансовые активы и финансовые технологии		
ПК-3.1	Разрабатывает методологию финансового консультирования и финансового планирования	**Перечень теоретических вопросов к экзамену:** 1. Понятие финансовых активов и их классификация 2. Процесс управления финансовыми активами 3. Финансовые активы с фиксированными доходами 4. Производные финансовые активы 5. Финансовые риски и их оценка

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		6. Оценка эффективности вложений в финансовые активы 7. Понятия и методы формирования инвестиционного портфеля 8. Модели оценки стоимости финансовых активов 9. Сущность и виды финансовых технологий 10. Характеристика продуктов, основанных на финансовых технологиях 11. Технология Блокчейн 12. Понятие и методы аутентификации 13. Понятие и необходимость скоринга 14. Модели использования финансовых технологий нефинансовыми компаниями 15. Факторы успеха и провала нефинансовых компаний на рынке финансовых услуг 16. Оценка эффективности внедрения финансовых технологий нефинансовыми компаниями 17. Государственный финтех 18. Особенности внедрения финансовых технологий в организациях финансового сектора **Задачи:** 1. Определите реальную процентную ставку за год, если номинальная простая процентная ставка равна 11% при годовом темпе инфляции 8%. Какова должна быть номинальная процентная ставка, чтобы при такой инфляции обеспечить реальную доходность 14% годовых? 2. Клиент положил в банк на депозит 150 тыс. руб. на полгода под простую процентную ставку 11% годовых. Определите реальную сумму, которую получит клиент через полгода, если среднемесячный темп инфляции составил 1,3%? Чему равна реальная доходность такой финансовой операции для клиента в виде годовой простой процентной ставки? При какой процентной ставке сумма на депозите реально останется постоянной? 3. Предприниматель получил в банке кредит 280 тыс. руб. на год. Какую процентную ставку по кредиту должен установить банк, чтобы обеспечить реальную доходность этой финансовой операции в 12% годовых при ожидаемом годовом темпе инфляции 10%? Какую сумму должен будет вернуть предприниматель? 4. Банк выпустил сберегательный сертификат на 6 месяцев номиналом 10000 руб., который продается по цене 7750 руб. При погашении данного сертификата выплачивается сумма 10000 руб. рассчитайте годовой доход по данному сертификату. 5. Рассчитать арбитражную прибыль (убыток), полученную в результате процентного арбитража с форвардным покрытием. Стоимость капитала составляет 30 тыс. евро, при продаже на доллары США по текущему курсу 1,2 она составит 36 тыс. долларов США. Депозит на шесть месяцев при ставке 3 % годовых по евро и 4,5 % годовых по долларам США. На день исполнения депозита курс евро к доллару США составил 1,3. Сделать вывод об эффективности вложения капитала на депозит. 6. Корпоративные облигации можно эмитировать по номиналу, со скидкой или с премией. Компания намерена эмитировать новые 10-летние облигации. Ставка дисконтирования для этих облигаций равна 15%. (а) Какой должна быть купонная ставка, чтобы можно было эмитировать эти облигации по номиналу? (б) Если номинал облигации равен 1000 руб., а купонная ставка - 10%, то какова теоретическая стоимость этих облигаций?

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Перечень теоретических вопросов к экзамену: 1. Понятие финансовых активов и их классификация 2. Процесс управления финансовыми активами 3. Финансовые активы с фиксированными доходами 4. Производные финансовые активы 5. Финансовые риски и их оценка 6. Оценка эффективности вложений в финансовые активы 7. Понятия и методы формирования инвестиционного портфеля 8. Модели оценки стоимости финансовых активов 9. Сущность и виды финансовых технологий 10. Характеристика продуктов, основанных на финансовых технологиях 11. Технология Блокчейн 12. Понятие и методы аутентификации 13. Понятие и необходимость скоринга 14. Модели использования финансовых технологий нефинансовыми компаниями 15. Факторы успеха и провала нефинансовых компаний на рынке финансовых услуг 16. Оценка эффективности внедрения финансовых технологий нефинансовыми компаниями 17. Государственный финтех 18.Особенности внедрения финансовых технологий в организациях финансового сектора
ПК-3.2	Формирует стандарты и внутренние регламенты по процессу финансового консультирования и финансового планирования	**Тест:** **1. Коэффициент вариации составляет 0,3:** а) это означает, что риск высокий, б) это означает, что риск актива средний, в) это означает, что степень риска низкая, г) это означает, что риск равен нулю. **2. В управлении рисками используют следующие подходы:** а) агрессивный, б) прямой, в) статистический, г) верного ответа нет. **3. Ковариация имеет отрицательное значение, если:** а) доходности активов, входящих в портфель, изменяются однонаправлено, б) доходности активов, входящих в портфель, изменяются разнонаправлено,

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) доходности активов, входящих в портфель, не связаны друг с другом, г) нет верного ответа. **4. При допустимом финансовом риске уровень потерь не превышает:** а) прибыли по осуществляемой операции, б) выручки от реализации, в) частичной потери собственного капитала, г) верного ответа нет. **5. Для получения безрисковой комбинации при формировании портфеля необходимо:** а) объединение активов, доходности которых связаны прямой функциональной зависимостью, б) объединение активов, доходности которых связаны обратной функциональной зависимостью. **6. Для оценки риска портфеля используются:** а) ковариация, б) коэффициент корреляции, в) коэффициент вариации, г) все вышеперечисленное верно. **7. Какой из методов оценки риска предполагает обратную связь между экспертом и организацией, заказавшей определение степени риска:** а) «дерево решений», б) оценка вероятности наступления неблагоприятного события, в) оценка финансового состояния организации, г) верного ответа нет. **8. Определите вид риска: «Он связан с возможностью невыплаты процентов и основной суммы долга заемщиком»:** а) кредитный, б) производственный, в) валютный, г) систематический. **9. К проявлениям налогового риска относятся:** а) увеличение темпов инфляции, б) возникновение финансовых потерь в процессе осуществления инвестиционной деятельности организации,

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		в) изменение порядка и условий уплаты ряда налогов, г) верного ответа нет. **10. Для управления рисками возможно использование следующих методов:** а) диверсификация, б) страхование, в) хеджирование, г) все вышеперечисленное можно использовать. **11. К финансовым рискам относятся:** а) коммерческий риск, б) страновой риск, в) инфляционный риск, г) нет верного ответа. **12. Активный метод управления риском предполагает:** а) осуществление всех операций после проведения мероприятий по предупреждению финансовых потерь, б) учет в процессе управления риском сложившихся условий хозяйствования, в) меры по минимизации риска принимаются после наступления рискового события, г) верного ответа нет. **13. По мнению Марковица инвестор должен принимать решение по выбору портфеля, основываясь на:** а) ковариации и коэффициенте корреляции, б) ожидаемой доходности и среднеквадратическом отклонении бумаг, входящих в портфель, в) ожидаемой доходности и среднеквадратическом отклонении портфеля, г) верного ответа нет. **14. В каком случае дисперсия и среднеквадратическое отклонение дают неверную оценку риска:** а) распределение является симметричным, б) распределение вероятностей имеет правостороннюю ассиметрию, в) распределение вероятностей имеет левостороннюю ассиметрию, г) во всех перечисленных случаях. **15. Модель CAPM:** а) имеет допущения,

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		б) не имеет допущений. **16. β – коэффициент измеряет относительную изменчивость ценной бумаги, рассчитываемую с помощью рыночного индекса ценных бумаг:** а) утверждение верно, б) утверждение неверно. **17. В модели CAPM наградой за ожидание называется:** а) наклон CML, б) наклон SML, в) рыночная доходность, г) безрисковая доходность. **18. Выберите верное утверждение:** а) добавление в портфель акции, имеющей $\beta>1$, увеличивает значение β портфеля, б) добавление в портфель акции, имеющей $\beta<1$, увеличивает значение β портфеля, в) все вышеперечисленное верно. **19. Бета - коэффициент позволяет измерить:** а) кредитный риск, б) инфляционный риск, в) налоговый риск, г) верного ответа нет. **20. В соответствии с моделью CAPM рынки ценных бумаг совершенны:** а) утверждение верно, б) утверждение неверно. **21. Модель CAPM основана на предположениях:** а) инвесторы производят оценку инвестиционных портфелей, основываясь на ожидаемых доходностях и их среднеквадратических отклонениях, б) отсутствие безрисковой доходности, в) операционные издержки подлежат обязательному учету, г) все вышеперечисленное верно. **22. Безрисковая доходность состоит из:**

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		а) реальной безинфляционной доходности, б) инфляционной премии, в) рыночной премии за риск, г) нет верного ответа. **23. Бета портфеля представляет собой взвешенное среднее коэффициентов бета, входящих в него ценных бумаг, где в качестве весов выступают доли инвестиций в эти бумаги:** а) утверждение верно, б) утверждение неверно. **24. Если ценная бумага имеет бета менее 1, то:** а) она называется «агрессивной акцией», б) она называется «оборонительной акцией», в) все вышеперечисленное верно. **25. Консервативный метод управления риском предполагает:** а) осуществление всех операций после проведения мероприятий по предупреждению финансовых потерь, б) учет в процессе управления риском сложившихся условий хозяйствования, в) меры по минимизации риска принимаются после наступления рискового события, г) верного ответа нет. **26. Дисперсия – это:** а) показатель, используемый для измерения доходности актива, б) показатель, используемый для оценки индивидуального риска, в) показатель, используемый для оценки риска портфеля, г) нет верного ответа. **27. К качественным методам оценки риска относятся:** а) статистический, б) метод экспертных оценок, в) метод использования аналогов, г) все вышеперечисленное верно. **28. Для оценки индивидуального риска используются:** а) ковариация,

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		б) коэффициент корреляции, в) коэффициент вариации, г) все вышеперечисленное верно. **29. Выберите верное утверждение:** а) чем выше коэффициент вариации, тем менее рискованным является данный вид актива, б) чем ниже коэффициент вариации, тем более рискованным является данный вид актива, в) чем выше коэффициент вариации, тем более рискованным является данный вид актива, г) верного ответа нет. **30. При критическом финансовом риске уровень потерь не превышает:** а) прибыли по осуществляемой операции, б) выручки от реализации, в) частичной потери собственного капитала, г) верного ответа нет. **31. По характеру проявления во времени выделяют:** а) внешний и внутренний риски, б) постоянный и переменный, в) простой и сложный, г) верного ответа нет. **32. Требуемый уровень доходности в модели CAPM зависит от следующих показателей:** а) минимальный уровень доходности на рынке, б) доходность рыночного портфеля, в) β – коэффициент, г) все вышеперечисленные. **33. Если $\beta>1$, то:** а) акции данной компании имеет среднюю степень риска, б) ценные бумаги менее рискованны, чем в среднем на рынке, в) ценные бумаги более рискованны, чем в среднем на рынке. **34. Уравнение рыночной линии ценной бумаги устанавливает зависимость между:** а) дисперсией и ожидаемой доходностью,

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		б) ковариацией и рыночной доходностью, в) бета коэффициентом и требуемой доходностью, г) бета коэффициентом и безрисковой доходностью. **35. При β = 1:** а) риск вложений в ценные бумаги равен общерыночному, б) риск вложений выше общерыночного, в) риск вложений ниже общерыночного.
ПК-3.3	Разрабатывает перспективные и текущие программы, мероприятия, схемы материально-финансового и организационного обеспечения процесса финансового консультирования	***Комплексное задание по разработке проекта и его презентации***: Разработайте концепцию внедрения финансовых технологий в деятельность: - образовательной организации - торговой организации - благотворительного фонда - организации по переработке отходов - организации грузоперевозчики - предприятия, оказывающие бытовые услуги населению
Учебная - практика по получению первичных профессиональных умений и навыков		
ПК-3.1	Разрабатывает методологию финансового консультирования и финансового планирования	**Задание на практику:** – организовать библиографический поиск литературных и электронных научных, нормативно-методических и учебных источников отечественных и зарубежных авторов для уточнения темы и проблем магистерского исследования, сформулировать цели, задачи, актуальность исследуемой проблемы, научной новизны; – исследовать научную проблему и составить обзор литературных, научных и нормативно-методических источников отечественных и зарубежных авторов для написания научных статей, докладов, теоретической части выпускной квалификационной работы; – обработать информацию методами и приемами, предусмотренными в программе исследования; – сформулировать собственное мнение по проблемам исследования, выводы и предложения по совершенствованию управления рисками на исследуемом предприятии; – составить отчет по практике и подготовить его к защите.
ПК-3.2	Формирует стандарты и внутренние регламенты по процессу финансового консультирования и финансового планирования	
ПК-3.3	Разрабатывает перспективные и текущие программы,	

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	мероприятия, схемы материально-финансового и организационного обеспечения процесса финансового консультирования	
Производственная – научно-исследовательская работа		
ПК-3.1	Разрабатывает методологию финансового консультирования и финансового планирования	**Практические задания:** 1. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов исследования научному сообществу. 2. Подготовка и оформление рукописи выпускной квалификационной работы.
ПК-3.2	Формирует стандарты и внутренние регламенты по процессу финансового консультирования и финансового планирования	
ПК-3.3	Разрабатывает перспективные и текущие программы, мероприятия, схемы материально-финансового и организационного обеспечения процесса финансового консультирования	
Производственная – преддипломная практика		
ПК-3.1	Разрабатывает методологию финансового	**Задание на практику:** – подготовить рекомендации по развитию применяемых финансовых технологий и совершенствованию системы управления

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	консультирования и финансового планирования	рисками (рекомендации должны быть обоснованными, т.е. сопровождаться ссылками на соответствующие нормативно-правовые акты или авторитетное мнение специалистов в сфере деятельности, исследователей, конкурентов, потребителей и т.п.); – подготовить выводы о деятельности предприятий или организаций, в области применения финансовых технологий и управления рисками, а также практические рекомендации по совершенствованию организационных и экономических аспектов их деятельности в условиях неопределенности; – систематизировать и обобщить материалы для написания выпускной квалификационной работы; – составить отчет по практике и подготовить его к защите
ПК-3.2	Формирует стандарты и внутренние регламенты по процессу финансового консультирования и финансового планирования	
ПК-3.3	Разрабатывает перспективные и текущие программы, мероприятия, схемы материально-финансового и организационного обеспечения процесса финансового консультирования	
ПК-4: Способен самостоятельно проектировать новые продукты и бизнес-модели в сфере финансовых технологий с учетом фактора неопределенности		
Современные банковские продукты и технологии		
ПК-4.1	Проводит предпроектное исследование и анализ возможностей внедрения нового продукта и бизнес-модели в области финансовых технологий	**Перечень практических заданий к экзамену:** №1. На основании бухгалтерской отчетности коммерческого банка за 2 года (бухгалтерский баланс, отчет о финансовых результатах): - составьте агрегированные баланс и отчет о финансовых результатах коммерческого банка, проанализируйте их и сделайте выводы; - на основе агрегированных баланса и отчета о финансовых результатах оцените эффективность управления банковскими ресурсами и осуществления банковских операций (активных, пассивных, активно-пассивных); – оцените возможности внедрения нового продукта и бизнес-модели в области финансовых технологий. * Данные для выполнения задания обучающиеся подбирают самостоятельно, используя официальные сайты коммерческих банков в Интернет-ресурсах. №2. Субъект банковского бизнеса располагает капиталом 1,0 млрд. ден. ед., в том числе его собственный капитал составляет 200,0 млн. ден. ед. По пассивным операциям коммерческий банк уплачивает 5,0% годовых, а по активным получает 6,0% годовых. Административно-технические издержки коммерческого банка составляют 200,0 тыс. ден. ед., норма обязательных резервов – 10,0%. Рассчитайте норму

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		чистой банковской прибыли, если в ссуду отдан весь капитал, оцените возможности внедрения нового продукта и бизнес-модели в области финансовых технологий. №3. На основе показателей, приведенных ниже, постройте основной источник информационного обеспечения банковского менеджмента - баланс коммерческого банка, соответствующий регулятивным требованиям Центрального банка России к финансовой отчетности, ден. ед.: уставный фонд – 2227305,0; прибыль – 8154894,0; касса – 2695503,0; счета в других коммерческих банках (корресп.счета) – 8625924,0; средства в Центральном банке России – 7681650,0; кредиты, выданные коммерческим банком, - 59908900,0; средства на счетах коммерческого банка других банков – 1523683,0; прочие пассивы – 7855415,0; другие фонды – 4575298,0; вклады и депозиты – 6293671,0; иностранная валюта и расчеты по валютным операциям (пассив) – 2991709,0; приобретение ценных бумаг – 1262603,0; прочие активы – 14649731,0; иностранная валюта и расчеты по валютным операциям (актив) – 3691699,0; здания и основные средства – 768121,0; участие в совместной деятельности – 110458,0; кредиты, полученные от других коммерческих банков, - 30013078,0; остатки на расчетных и текущих счетах – 35759631,0. На основе сформированного баланса оцените эффективность управления банковскими ресурсами и осуществления банковских операций (активных, пассивных, активно-пассивных). Оцените возможности внедрения нового продукта и бизнес-модели в области финансовых технологий.
ПК-4.2	Разрабатывает проектные решения в области финансовых технологий с учетом критериев экономической эффективности и риска, а также предложения и мероприятия по реализации разработанных проектов/ программ	**Примерные практические задания для экзамена:** №1. Проанализируйте информацию на официальном сайте коммерческого банка (коммерческий банк – выбор обучающегося) по показателям, характеризующим эффективность его деятельности - доходы, расходы и прибыль, и предложите проектное решение в области финансовых технологий с учетом критериев экономической эффективности и риска.
Производственная – преддипломная практика		
ПК-4.1	Проводит предпроектное исследование и анализ возможностей внедрения нового продукта и бизнес-модели в области финансовых	**Задание на практику:** – подготовить рекомендации по развитию применяемых финансовых технологий и совершенствованию системы управления рисками (рекомендации должны быть обоснованными, т.е. сопровождаться ссылками на соответствующие нормативно-правовые акты или авторитетное мнение специалистов в сфере деятельности, исследователей, конкурентов, потребителей и т.п.); – подготовить выводы о деятельности предприятий или организаций, в области применения финансовых технологий и управления рисками, а также практические рекомендации по совершенствованию организационных и экономических аспектов их деятельности в условиях неопределенности;

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	технологий	– систематизировать и обобщить материалы для написания выпускной квалификационной работы; – составить отчет по практике и подготовить его к защите
ПК-4.2	Разрабатывает проектные решения в области финансовых технологий с учетом критериев экономической эффективности и риска, а также предложения и мероприятия по реализации разработанных проектов/ программ	
ПК-5: Способен строить интегрированные системы управления рисками организации		
Риски предпринимательской деятельности		
ПК 5.1	Разрабатывает и внедряет методологические основы интегрированной системы управления рисками	***Перечень теоретических вопросов к зачету:*** 1. Понятие финансового предпринимательства. Характеристика факторов макросреды финансового предпринимательства. 2. Характеристика факторов микросреды финансового предпринимательства. 3. Риск как экономическая категория. Условия определенности и неопределенности. 4. Характеристика предпринимательского риска. 5. Виды рисков, основные элементы классификации рисков. 6. Основные причины и источники хозяйственного риска. 7. Внешние и внутренние предпринимательские риски. 8. Стратегия управления предпринимательскими рисками. 9. Основные задачи и принципы управления риском. 10. Политика (этапы) управления риском. 11. Основные условия избежания риска. 12. Основные методы системы внутренних механизмов нейтрализации рисков. 13. Статистические методы принятия решений в условиях риска. 14. Сценарный подход к оценке риска. 15. Метод чувствительности в оценке риска. 16. Метод «дерево решений» в оценке риска. 17. Экспертный метод оценки риска. 18. Метод Дельфи.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		19. Оценка степени риска в условиях определенности. 20. Классификация финансовых рисков. 21. Риски развития, процентные риски. Характеристика. 22. Анализ кредитных рисков. 23. Оценка риска на основе финансовой отчетности. 24. Совокупный предпринимательский риск и методы его оценки. 25. Риск инвестиций. Характеристика. 26. Валютные риски, меры по снижению валютных рисков. 27. Общая схема процесса управления риском. 28. Диверсификация как метод снижения риска. 29. Сущность страхования риска. 30. Хеджирование, основные понятия. 31. Опционы. Отличие страхования от хеджирования. 32. Лимитирование средств, самострахование как методы снижения риска. 33. Основные решения снижения риска. 34. Коэффициент бета. Премия за риск.
ПК-5.2	Осуществляет стратегическое регулирование, контроль и аудит внедрения интегрированной системы управления рисками	***Примерные практические задания для зачета:*** **Задание 1.** Правильно ли оценены ценные бумаги, если ставка свободная от риска составляет 8%.Доходность акций компании А оценивается в 16,1%, акций В – 22,4%. Бета акций А- 0,9, бета акций В- 1,6. **Задание 2.** Применяя метод анализа чувствительности, определите чувствительность проекта к изменению объема производства и цене изделия. Исходные данные. Инвестор решает вопрос об инвестировании 570 тыс.рублей в проект. Объем производства и реализации продукции при реализации проекта составит 1500 изделий в месяц. Цена реализации одного изделия – 480 рублей, себестоимость единицы – 290 рублей.Диапазон изменения параметров -80%, 90%, 100%, 110%, 120%. Оценку эффективности проекта произвести за 10 периодов. **Задание 3.** Применяя метод анализа чувствительности, определите чувствительность проекта к изменению объема производства и цене изделия. Исходные данные. Инвестор решает вопрос об инвестировании 570 тыс.рублей в проект. Объем производства и реализации продукции при реализации проекта составит 1500 изделий в месяц. Цена реализации одного изделия – 480 рублей, себестоимость единицы – 290 рублей. Диапазон изменения параметров -80%, 90%, 100%, 110%, 120%. Оценку эффективности проекта произвести за 10 периодов. **Задание 4.** Фирма планирует построить среднее или малое предприятие по производству продукции. Рассматривается вариант строительства среднего предприятия, или малого предприятия с последующим расширением производства через 2 года, если сформируется высокий спрос на продукцию. Фирма рассматривает задачу на 10-летний период. Маркетинговый анализ рынка показал, что вероятность высокого спроса –

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		0,65%, низкого спроса – 35%. Инвестиции в строительство среднего предприятия – 7,5 млн. руб. Инвестиции в малое предприятие – 1,8 млн. руб., затраты на его дальнейшее расширение – 3,4 млн. руб. Ожидаемые ежегодные доходы: По среднему предприятию: при высоком спросе – 1,4 млн.руб., при низком – 0,38 млн. руб. ежегодно в течение 10 лет. По малому предприятию: при высоком спросе – 0,27 млн.руб., при низком – 0,25 млн. руб. ежегодно в течение 2 лет. После расширения малого предприятия: при высоком спросе – 1,6 млн.руб., при низком – 0,24 млн. руб. ежегодно в течение 8 лет. Без расширения малого предприятия: при высоком спросе –0,27 млн.руб., при низком – 0,20 млн. руб. ежегодно в течение 8 лет. На основе «дерева решений» выбрать предпочтительный вариант инвестирования. **Задание 5.** Рассчитать совокупный предпринимательский риск компании. Ежегодно производится 100 тыс. единиц продукции. Цена реализации составляет 3500 рублей, средние переменные издержки составляют 1800 руб/шт. Постоянные издержки – 38500 тыс.руб. Величина собственного капитала организации составляет 800 тыс.руб. Сумма заемных источников – 550 тыс. руб. Средняя процентная ставка по кредитам – 14,5 %. Ставка налога на прибыль – 20%. **Задание 6.** Предложены следующие варианты сценариев реализации предпринимательских проектов. Таблица 3.3 Сценарии реализации предпринимательских проектов Состояние экономики | Вероятность наступления данного состояния | Проект C, IRR, % | Проект D, IRR.% подъем | 0,4 | 45 | 125 норма | 0,3 | 38 | 75 спад | 0,3 | 15 | 20 *Примерный перечень тем комплексной исследовательской работы:* 1. Совершенствование методов устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса). 2. Разработка новых методов устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса). 3. Адаптация существующих механизмов (инструментов) устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса). 4. Разработка новых механизмов (инструментов) устойчивого развития экономики предприятия, организации (отрасли, комплекса). 5. Совершенствование инструментов внутрифирменного планирования в риск-менеджменте организации.
Рискология		

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td>ПК-5.1</td><td>Разрабатывает и внедряет методологические основы интегрированной системы управления рисками</td><td>

Перечень теоретических вопросов к зачету и экзамену:

1. Риск как экономическая категория. Категориальный анализ риска.
2. Сущность риска как явления и квалиметрические характеристики риска.
3. Риск как случайное и закономерное явление, вероятность и возможность.
4. Неопределенность как источник риска.
5. Теория хаоса и теория бифуркаций в исследовании риска.
6. Концепции риска как теоретический и методологический источник рискологии.
7. Варианты экономических решений, обремененных риском. Альтернативы.
8. Принципы системного анализа риска в спектре экономических проблем.
9. Качественный и количественный анализ риска.
11. Использование набора показателей для количественной оценки риска

Примерные практические задания для зачета и экзамена:

Задача № 1.

Проводятся испытания нового лекарства. В эксперименте участвуют n_1 = 3000 мужчин и n_2 = 3500 женщин. У 50 мужчин и 110 женщин наблюдаются побочные эффекты. Оценить наличие риска побочных эффектов преимущественно у женщин по сравнению с мужчинами при доверительной вероятности p = 95%.

Задача № 2.

Студенты сдавали экзамены по физике и математике, результаты которых представлены в таблице 1.

Таблица 1 – Результаты экзаменов по физике и математике

Результаты экзамена по математике	Результаты экзамена по физике			
	отлично	хорошо	удовл.	неуд.
отлично	20	17	12	6
хорошо	22	15	17	5
удовл.	21	19	20	13
неуд.	9	8	7	18

Идентифицировать риск взаимосвязи между результатами экзаменов по физике и математике (доверительная вероятность p = 99%).

Задача № 3.

Фирма проводит анализ открытия нового магазина для расширения бизнеса. В случае открытия крупного магазина при благоприятной конъюнктуре рынка прогнозируется прибыль 600 млн. руб. / год, при неблагоприятной конъюнктуре – убыток 400 млн. руб. / год. В случае открытия среднего магазина при благоприятной конъюнктуре его прибыль прогнозируется на уровне 300 млн. руб. / год, при неблагоприятной конъюнктуре рынка – убыток 100 млн. руб. / год. Возможность благоприятной и

</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		неблагоприятной конъюнктуры рынка фирма оценивает одинаково. Исследования рынка экспертом обойдется фирме в 1 млн. руб. Специалист считает, что с вероятностью 0,6 конъюнктура рынка окажется благоприятной. При этом при положительном заключении эксперта конъюнктура рынка окажется благоприятной лишь с вероятностью 0,9. При его отрицательном заключении конъюнктура рынка может оказаться благоприятной с вероятностью 0,12. Использовать метод дерева решений для проверки этих вариантов. Оценить риск фирмы в случае заказа экспертного исследования рынка. Оценит риски вариантов открытия крупного и среднего магазина. Выявить стоимостную оценку наилучшего варианта решения. ***Направления исследований для зачета и экзамена:*** 1. Концептуальные принципы рискологии в экономике и предпринимательстве. 2. Анализ системы постулатов и аксиом рискологии, исследование риска как экономической категории. 3. Нормальное распределение (распределение Гаусса) случайной величины как инструмент оценки и анализа рисков. 4. Оценка риска как система количественного и качественного анализа рисков, математическая оценка меры и степени риска. 5. Портфельные риски в условиях стратегического и тактического размещения активов. 6. Исследование вопросов формирования премии за риск в условиях инвестиционной деятельности. 7. Исследование региональных рисков в условиях формирования научно-производственных кластеров. 8. Рейтинг как способ качественной оценки рисков на основе формализации экспертных методов: ранжирование рисков. 9. Рисковая ситуация как сочетание факторов, определяющих состояние исследуемого объекта и выбор критериев риска. 10.Степень риска как показатель, количественная характеристика неблагоприятной динамики управляемого процесса и негативных результатов деятельности.
ПК-5.2	Осуществляет стратегическое регулирование, контроль и аудит внедрения интегрированной системы управления рисками	***Перечень теоретических вопросов к зачету и экзамену:*** 1. Негэнтропия как характеристика и мера упорядоченности экономических систем. 2. Роль управленческой деятельности в реализации негэнтропийного подхода к управлению рисками современной организации. 3. Энтропия как мера хаотичности, неупорядоченности экономической системы и необходимость управления рисками. 4. Риск-менеджмент как функциональная область современной организации. 5. Риск-менеджмента как подсистема стратегического управления в условиях цифровой экономики XXI века. 6. Методы финансового анализа в управлении риском: показатели ликвидности и платежеспособности. 7. Методы финансового анализа в управлении риском: показатели финансовой устойчивости организации. 8. Современная парадигма риск-менеджмента организации: интегрированный риск-менеджмент. 9. Системный подход в риск-менеджменте. Карта рисков. 10. Рисковая ситуация в организации: ее факторы, параметры и характеристики. Примерные практические задания для зачета и экзамена: Задача № 1. Производитель и потребитель договорились о следующих стандартах поставляемого изделия: AQL = 0,05; LTPD = 0,25; α =

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		0,15; β = 0,03. Если в выборке n = 15 изделий окажется более двух изделий, не соответствующих стандартам, то вся партия бракуется. Оценить риск несоответствия приведенной схемы заявленным параметрам. Задача № 2. Функция спроса некоторого товара $D(P) = 60 + 4P_1 - 3P_2 + 0{,}5Y$. Определить эластичность спроса от собственной цены производителя E_1, перекрестный коэффициент эластичности спроса E_2, эластичность спроса от дохода потребителей E_Y при отпускной цене товара P_1 = 600 руб., цене альтернативного товара P_2 = 500 руб. и доходе потребителей Y = 70000 руб. Установить, как ведет себя спрос с ростом доходов потребителей. Задача № 3. По состоянию на конец финансового года внеоборотные активы компании составили 875 220 800 руб., оборотные активы – 177 604 800 руб., краткосрочные обязательства – 103 679 800 руб. Объем продаж за отчетный период составил 1 437 740 500 руб. Определить коэффициент оборачиваемости активов и оценить финансовый риск компании. Направления исследований для зачета и экзамена: 1.Негэнтропия как характеристика и мера упорядоченности экономических систем. 2.Роль управленческой деятельности в реализации негэнтропийного подхода к управлению рисками современной организации. 3.Энтропия как мера хаотичности, неупорядоченности экономической системы и необходимость управления рисками. 4.Риск-менеджмент как функциональная область современной организации. 5.Риск-менеджмента как подсистема стратегического управления в условиях цифровой экономики XXI века. 6.Методы финансового анализа в управлении риском: показатели ликвидности и платежеспособности. 7.Методы финансового анализа в управлении риском: показатели финансовой устойчивости организации. 8.Современная парадигма риск-менеджмента организации: интегрированный риск-менеджмент. 9.Карта рисков. Особенности когнитивного подхода в идентификации и управлении рисками. 10.Рисковая ситуация как инструмент анализа поля рисков современной организации. 11. Метод аналогии в оценке и управлении риском и его применение для разработки сценариев действий. 12. Метод дерева решений: оценка наиболее вероятных результатов, построение пространственно-ориентированного графа. 13. Метод Монте-Карло как вариант статистических испытаний в оценке и управлении риском в наиболее сложных для прогнозирования расчетах. 14. Методы портфолио в исследовании рисков: методы портфельной теории, теории случайных блужданий, теории капитальных активов. 15. Моделирование рисков в прогнозных и проектных расчетах. 16. Особенности идентификации и анализа научно-технических рисков. 17. Феномен неопределенности как источника риска, неполноты или неточности информации, невозможности полного и исчерпывающего анализа всех факторов риска.

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td colspan="3">Риски и финансовый контроль в бизнесе</td></tr>
<tr><td>ПК-5.1</td><td>Разрабатывает и внедряет методологические основы интегрированной системы управления рисками</td><td>Перечень теоретических вопросов к зачету:
1. Понятие, виды неопределенности и риска при оценке эффективности бизнес-проекта.
2. критерии эффективности бизнес-проектов, учитывающие фактор неопределенности.
3. Оценка риска по жизненному циклу проекта.
4. Подготовка и планирование проведения ревизии. Рисковый аспект.
5. Основные этапы и последовательность ревизионных работ, их документирование.
6. Методы и специальные методические приемы документального и фактического контроля при проведении ревизии.
7. Выводы и предложения по материалам ревизии. Акт ревизии</td></tr>
<tr><td>ПК-5.2</td><td>Осуществляет стратегическое регулирование, контроль и аудит внедрения интегрированной системы управления рисками</td><td>Примерные практические задания для зачета:
<u>Задача № 1</u>.
Рассмотрите риск как экономическую категорию, заполнив таблицу.
<table>
<tr><th>Направление изучения риска</th><th>Содержание</th></tr>
<tr><td>Определение риска</td><td></td></tr>
<tr><td>Причины</td><td></td></tr>
<tr><td>Черты</td><td></td></tr>
<tr><td>Функции</td><td></td></tr>
<tr><td>Последствия</td><td></td></tr>
</table>
<u>Задача № 2</u>.
Раскройте содержание следующих характеристик риска:
<table>
<tr><th>Характеристики риска</th><th>Пояснение</th></tr>
<tr><td>Вероятность</td><td></td></tr>
<tr><td>Уровень</td><td></td></tr>
<tr><td>Степень</td><td></td></tr>
<tr><td>Приемлемость</td><td></td></tr>
<tr><td>Правомерность</td><td></td></tr>
</table>
<u>Задача № 3</u>.
<table>
<tr><td>Израсходовано из подотчетных сумм по утвержденным отчетам, всего</td><td>40265</td><td>49138</td><td>65129</td><td>154532</td></tr>
<tr><td>Остаток на конец месяца:</td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td>а) по дебету (суммы под отчетом)</td><td>19552</td><td>19838</td><td>9756</td><td>-</td></tr>
<tr><td>б) по кредиту (невозмещенный перерасход)</td><td>3949</td><td>12183</td><td>7763</td><td>-</td></tr>
</table>
На основании приведенных данных необходимо:
1 Указать отрицательные моменты в использовании подотчетных сумм.
2 Сделать запись для включения в акт ревизии.
3 Разработать мероприятии по снижению финансовых рисков.</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

Задача № 4. Проверка состояния кредиторской задолженности и выполнения программы снижения рисков.

По данным бухгалтерского баланса производственного объединения «Луч» имеется кредиторская задолженность, включая задолженность по заработной плате, на начало года 6806 тыс. руб., на конец года 4612 тыс. руб. За отчетный год было погашено за счет целевого финансирования и поступлений 170 тыс. руб.

Задание:

1 Определить реальную сумму кредиторской задолженности за отчетный год и проверить обязательства по ее снижению, если программой предусмотрено ее снижение на 5%.

2 Сформулировать запись для включения в акт ревизии.

Задача № 5. Определение результатов инвентаризации основных средств

При инвентаризации основных средств в бэк-офисе производственного объединения «Луч» по состоянию на 10 января 2019 года ревизором выявлена следующая информация (таблица 2).

Таблица 2 – Результаты инвентаризации основных средств объединения, руб.

Виды основных средств	Цена	Фактическое наличие		По данным учета	
		количество	сумма	количество	сумма
Компьютер X128	34500	2	69000	2	69000
Компьютер X277	38200	2	76400	2	76400
Компьютер X435	41000	3	123000	3	123000
Шкафы несгораемые	7300	3	21900	3	21900
Сейф	8450	1	8450	1	8450
Стол приставной 2-тумбовый	2900	2	5800	2	5800
Стол письменный 1-тумбовый	1600	3	4800	2	3200
Стол письменный 2-тумбовый	2100	3	6300	4	8400
Секретер	2000	1	2000	1	2000
Стенд	2700	2	5400	2	5400
Штора	3570	1	3570	2	7140
Люстра	15500	3	46500	4	62000
Шкаф книжный	2200	3	6600	3	6600

Согласно заданию на ревизию необходимо:

1 Составить сличительную ведомость и выявить результаты инвентаризации основных средств.

2 Составить бухгалтерские проводки по результатам инвентаризации основных средств.

3 Сформулировать запись для включения в акт ревизии.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
Стратегический менеджмент		
ПК-5.1	Разрабатывает и внедряет методологические основы интегрированной системы управления рисками	***Вопросы к экзамену*** 1. Международные и внутренние изменения, их влияние на стратегию предприятия. 2. Стратегические проблемы предприятия и классификация проблем. 3. Стратегический и оперативный менеджмент. Долгосрочное и стратегическое планирование. 4. Стратегический менеджмент: понятия и предпосылки. Концептуальные положения и основные черты стратегического управления. 5. Научные теории для формирования современной концепции стратегического управления. Школы стратегического управления 6. Организационные уровни стратегического управления. Сущность и характерные мероприятия для каждого уровня. 7. Формирование стратегии предприятия. Классификация стратегий. Сущность и характеристика стратегий поддержания. 8. Формирование стратегии предприятия. Сущность и характеристика стратегий концентрированного роста. 9. Формирование стратегии предприятия. Сущность и характеристика стратегий интегрированного роста. 10. Формирование стратегии предприятия. Сущность и характеристика стратегий диверсифицированного роста. 11. Формирование стратегии предприятия. Сущность и характеристика стратегий ухода. 12. Стратегии действий. Сущность и характеристика наступательных стратегий 13. Сущность и характеристика оборонительных и комбинированных стратегии действий. 14. Характеристики стратегий конкуренции. Преимущества и недостатки базовых конкурентных стратегий. 15. Этапы стратегического управления. Формирование миссии – стратегической установки организации. 16. Формирование стратегических целей. Установление стратегических целей по сферам, направлениям и показателям достижения цели. 17. Формирование стратегических целей. Установление стратегических целей по ключевым пространствам установления целей. Требования к стратегическим целям 18. Ситуационный анализ. Характеристики и цели анализа внешней среды предприятия. Матрицы возможностей и угроз. 19. PEST-анализ макросреды предприятия. Матрица профиля среды, взвешенная оценка, определение весовых коэффициентов. 20. Анализ непосредственного окружения. Анализ отрасли. Стратегическое значение экономических характеристик отрасли (в том числе, входные и выходные барьеры). 21. Факторы конкуренции в отрасли. Модель «пяти сил конкуренции» М. Портера. 22. Анализ положения конкурентов на рынке. Карта стратегических групп. 23. Выявление целей и стратегий конкурентов. Ключевые факторы успеха в конкурентной борьбе. 24. Анализ микросреды. Оценка эффективности действующей стратегии компании. 25. Анализ микросреды. Выявление ресурсного потенциала организации. 26. Анализ конкурентоспособности компании по ценам и издержкам. Анализ цепочки создания ценности. 27. Комплексная оценка конкурентоспособности предприятия. Использование взвешенной оценки. SWOT- анализ. Матрица решений как результат SWOT- анализа.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		28. Матрицы стратегического выбора в принятии решений. Матрица ADL-LC. Сущность, методика построения. 29. Матрицы стратегического выбора в принятии решений. Матрица БКГ. Сущность, методика применения, ограничения (правило соответствия). 30. Матрицы стратегического выбора в принятии решений. Матрица Мак-Кинси, сущность и методика построения. 31. Стратегии организации в зарождающейся отрасли и в отрасли на стадии зрелости. 32. Стратегии организации в отрасли на стадии роста и стадии стагнации или спада. 33. Функциональные стратегии и стадии жизненного цикла продукта. 34. Продуктово-маркетинговая стратегия. Этапы разработки. Риски реализации. 35. Стратегический маркетинг. Стратегия товара на разных этапах его жизненного цикла. 36. Стратегии ценообразования и их роль в разработке стратегии маркетинга. 37. Стратегии товаропродвижения, как элемент стратегии маркетинга. 38. Финансовая стратегия предприятия. Риски реализации финансовой стратегии. 39. Сущность и особенности разработки стратегии управления персоналом. Риски реализации стратегии управления персоналом. 40. Стратегия и организационная структура. Роль организационной структуры в реализации стратегии предприятия. Сетевые структуры. 41. Стратегия и техническая политика предприятия. Сущность и особенности разработки производственной стратегии. Риски реализации производственной стратегии. 42. Инновационная стратегия предприятия: сущность, содержание и риски реализации. 43. Стратегия организационных изменений. Оценка рисков при реализации стратегии. 44. Стратегический контроллинг: сущность и содержание. ***Примерные тестовые задания*** 1. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА ПРИ ВЫБОРЕ СТРАТЕГИЧЕСКИХ ДЕЙСТВИЙ ПО МАТРИЦЕ ADL/LC УЧИТЫВАЕТСЯ: 1. Относительная доля рынка и темп его роста 2. Привлекательность рынка – конкурентная позиция 3. Привлекательность рынка – конкурентная позиция и стадия жизненного цикла отрасли 4.Привлекательность рынка – конкурентная позиция и стадия жизненного цикла отрасли и другие факторы 4. Конкурентная позиция – стадии жизненного цикла отрасли 2. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА ЕСЛИ ПРЕДПРИЯТИЕ НЕ ОБЛАДАЕТ БОЛЬШИМ РЕСУРСНЫМ ПОТЕНЦИАЛОМ, ТО ЕМУ ЛУЧШЕ ВСЕГО ВЫБРАТЬ СТРАТЕГИЮ: 1. Лидерства по издержкам

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		2. Фокусирования 3. Оптимальных издержек 4. Дифференциации 3. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА ФУНКЦИОНАЛЬНЫЙ РУКОВОДИТЕЛЬ : 1. Отвечает за все аспекты деятельности организации 2. Не имеет права подписи 3. Принимает окончательные решения 4. Всегда подчиняется линейному руководителю 4. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА ОРГАНИЗАЦИОННАЯ СТРУКТУРА СОВРЕМЕННОЙ ОРГАНИЗАЦИИ ФОРМИРУЕТСЯ ИСХОДЯ ИЗ: 1. Специфики организации масштабов ее деятельности и принятой стратегии 2. Знания основных тенденций в отрасли 3. Финансовых возможностей владельцев организации 4. Опыта и знаний руководителя 5. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА ОПРЕДЕЛИТЬ СОДЕРЖАНИЕ ДЕЙСТВИЙ ПО МАТРИЦЕ МАК-КИНСИ ПРИ УСЛОВИИ, ЧТО КОНКУРЕНТНАЯ ПОЗИЦИЯ ОЦЕНЕНА В 2 БАЛЛА, ПРИВЛЕКАТЕЛЬНОСТЬ ОТРАСЛИ В 3 БАЛЛА (ПО ПЯТИБАЛЬНОЙ ШКАЛЕ): 1. Сохранение и усиление позиции, в том числе за счет приоритетного инвестирования 2. «Короткие» эффективные инвестиции, связанные с высокой вероятностью исчезновения рынка 3. Четкое определение наиболее перспективных сегментов рынка и целевое инвестирование для развития бизнеса в этих сегментах 4. Очень избирательное инвестирование в очень прибыльные и наименее рискованные мероприятия 5. Полная ликвидация бизнеса 6. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА ОПРЕДЕЛИТЬ СОДЕРЖАНИЕ ДЕЙСТВИЙ ПО МАТРИЦЕ БКГ ПРИ УСЛОВИИ, ЧТО ТЕМП РОСТА РЫНКА ПРОДУКТА ФИРМЫ СОСТАВЛЯЕТ 12%, ДОЛЯ РЫНКА ФИРМЫ, МЕНЬШЕ ЧЕМ У ЛИДЕРА. МАКСИМАЛЬНЫЙ ТЕМП РОСТА РЫНКА 20%: 1. Долю соответствующего бизнеса следует сохранять или увеличивать 2. Установить оптимальные инвестиции и жестко их контролировать. Приток наличности направлять на развитие других бизнесов 3. Целевые инвестиции для улучшения положения или сохранять уже имеющуюся долю рынка или сократить данный бизнес 4. Сокращение или ликвидация данных бизнесов

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		Практические работы **Методологические основания планирования деятельности организации** **Контрольные вопросы и задания:** 1. Определить роль и значение планирования в системе функций менеджмента. 2. Сформулировать задачи планирования в организации. 3. На основе анализа Федерального закона «О стратегическом планировании в Российской Федерации» от 28.06.2014 № 172-ФЗ (статья 3) указать временные интервалы, которые определены для среднесрочного и долгосрочного периода планирования. 4. Раскройте сущность принципов планирования: а) единство научно-технических, социальных и экономических задач развития организации; б) научная обоснованность и оптимальность решений; в) доминирование стратегических аспектов в планировании; г) комплексность планирования; д) ресурсная сбалансированность планов; е) гибкость и эластичность планирования; ж) непрерывность планирования. **Анализ макросреды организации** **Задание:** 1. Дать характеристику выбранной для анализа организации организации: (спектр выполняемых работ, выпускаемых товаров, услуг). 2. Провести PEST–анализ, для трех сценариев развития событий, посредством построения матрицы профиля среды и с помощью построения матриц возможностей и угроз. 3. Сопоставить результаты, полученные при использовании различных методов оценки. 4. Выявить наиболее значимые возможности и угрозы для деятельности организации. Сделать вывод о соотношении возможностей и угроз. **Анализ непосредственного окружения (мезосреды)** **Задание:** 1. Провести анализ ближнего окружения, для трех сценариев развития событий, используя матричные методы оценки (матрицы профиля среды, возможностей и угроз). 2. Сопоставить результаты, полученные при использовании различных методов оценки.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		3. Выявить наиболее значимые возможности и угрозы для деятельности организации. Сделать вывод о соотношении возможностей и угроз. **Анализ микросреды организации и построение матрицы решений** **Задание:** 1. Провести анализ микросреды организации с помощью *SNW*- анализа. 2. Уточнить перечень сильных и слабых сторон организации на основе комплексной оценки ее конкурентоспособности. 3. Построить матрицу *SWOT* на основе выявленных сильных и слабых сторон, возможностей и угроз со стороны дальнего окружения (по итогам проведенного *PEST* – анализа) и ближнего окружения. 4. Построить матрицу решений: а) базовая матрица SO («внешние возможности + внутренние сильные стороны организации»); б) матрица SOW («внешние возможности + внутренние сильные стороны организации – внутренние слабые стороны организации»; в) матрица SOT («внешние возможности + внутренние сильные стороны организации – внешние угрозы»). **Матрицы стратегического выбора** **Задание:** 1. Построить для своей организации модель *McKinsey* и определить набор стратегических инициатив в соответствии с привлекательностью отрасли и занимаемой конкурентной позицией. 2. Построить для своей организации матрицу *ADL* и определить возможный набор инициатив в соответствии со стадией жизненного цикла отрасли и конкурентной позицией. 3. Сравнить результаты выбора стратегических инициатив, полученных с помощью данных моделей. 4. В соответствии с полученными данными, и с учетом матрицы решений разработанной на основе *SWOT*-анализа скорректировать для своей организации стратегию развития, стратегию конкуренции и стратегию действий. **Разработка продуктово-маркетинговой стратегии организации** **Задание:** 1. Для своей организации разработать продуктово-маркетинговую стратегию, опираясь на информацию, полученную по результатам стратегического анализа организации. 2. Разработать продуктово-маркетинговую программу для наиболее приоритетных продуктов организации.
ПК-5.2	Осуществляет стратегическое	***Примерные тестовые задания*** 1. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	регулирование, контроль и аудит внедрения интегрированной системы управления рисками	ЕСЛИ ПРЕДПРИЯТИЕ НЕ ОБЛАДАЕТ БОЛЬШИМ РЕСУРСНЫМ ПОТЕНЦИАЛОМ, ТО ЕМУ ЛУЧШЕ ВСЕГО ВЫБРАТЬ СТРАТЕГИЮ: 1. Лидерства по издержкам 2. Фокусирования 3. Оптимальных издержек 4. Дифференциации 2. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА ПРЕИМУЩЕСТВА ЭФФЕКТА МАСШТАБА СИЛЬНЕЕ ВСЕГО ПРОЯВЛЯЮТСЯ В: 1. Единичном производстве 2. Мелкосерийном производстве 3. Опытном производстве 4. Массовом производстве 3. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА РЕЗУЛЬТАТ АНАЛИЗА СИЛЬНЫХ И СЛАБЫХ СТОРОН ОРГАНИЗАЦИИ, А ТАКЖЕ ОПРЕДЕЛЕНИЕ ВОЗМОЖНОСТЕЙ И ПРЕПЯТСТВИЙ ЕЕ РАЗВИТИЯ, ЭТО : 1. Стратегическое планирование 2. Стратегия 3. SWOT-анализ 4. Стратегическое управление 5. Долгосрочное планирование 5. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА ПРИ ВЫБОРЕ СТРАТЕГИЧЕСКИХ ДЕЙСТВИЙ ПО МАТРИЦЕ ADL/LC УЧИТЫВАЕТСЯ: 1. Относительная доля рынка и темп его роста 2. Привлекательность рынка – конкурентная позиция 3. Привлекательность рынка – конкурентная позиция и стадия жизненного цикла отрасли 4. Привлекательность рынка – конкурентная позиция и стадия жизненного цикла отрасли и другие факторы 5. Конкурентная позиция – стадии жизненного цикла отрасли 6. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЕ ВАРИАНТЫ*** ОТВЕТОВ БАЗОВАЯ СТРАТЕГИЯ ПРОИЗВОДСТВА ПРЕДПОЛАГАЕТ УЧЕТ: 1. Технического уровня производственного процесса и возможности модернизации оборудования 2. Уровня обеспеченности трудовыми ресурсами и их квалификации 3. Возможности быстрой переналадки оборудования 4. Инвестиционных приоритетов 5. Будущего спроса на продукцию 7. УКАЖИТЕ ***ПЕРВЫЕ ЧЕТЫРЕ ДЕЙСТВИЯ*** ПРИ РАЗРАБОТКЕ ПРОДУКТОВО-МАРКЕТИНГОВОЙ СТРАТЕГИИ:

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		1. Определение продуктового профиля и выявление приоритетных позиций 2. Исследование жизненного цикла товаров 3. Выявление возможностей и угроз для продукта организации со стороны ближнего и дальнего окружения 4. SNW-анализ 5. Комплексная оценка конкурентоспособности предлагаемых товаров и услуг 6. SWOT-анализ и матрица решений на его основе 7. Выбор базовых конкурентных стратегий 8. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНУЮ ПОСЛЕДОВАТЕЛЬНОСТЬ*** ОПРЕДЕЛИТЕ ПОРЯДОК ОСУЩЕСТВЛЕНИЯ ДЕЙСТВИЙ ПРИ РАЗРАБОТКЕ ПРОДУКТОВО-МАРКЕТИНГОВОЙ СТРАТЕГИИ 1. PEST- анализ, SNW-анализ, SWOT-анализ, Матрица решений 2. SNW-анализ, SWOT-анализ, PEST- анализ, Матрица решений 3. SWOT-анализ, PEST- анализ, Матрица решений, SNW-анализ 4. Матрица решений, SNW-анализ, SWOT-анализ, PEST- анализ **Анализ микросреды организации и построение матрицы решений** **Задание:** 1. Провести анализ микросреды организации с помощью *SNW*- анализа. 2. Уточнить перечень сильных и слабых сторон организации на основе комплексной оценки ее конкурентоспособности. 3. Построить матрицу *SWOT* на основе выявленных сильных и слабых сторон, возможностей и угроз со стороны дальнего окружения (по итогам проведенного *PEST* – анализа) и ближнего окружения. 4. Построить матрицу решений: а) базовая матрица SO («внешние возможности + внутренние сильные стороны организации»); б) матрица SOW («внешние возможности + внутренние сильные стороны организации – внутренние слабые стороны организации»; в) матрица SOT («внешние возможности + внутренние сильные стороны организации – внешние угрозы»).
Финансовый риск-менеджмент (продвинутый уровень)		
ПК-5.1	Разрабатывает и внедряет методологические основы интегрированной системы управления рисками	***Вопросы для экзамена:*** 1.Понятие риска как экономической категории. Сущность риска и основные причины его возникновения. 2. Характеристика финансового риска как субъекта управления. 3. Характеристика основных теорий финансовых рисков. 4. Место финансовых рисков в общей классификации рисков. 5. Современные классификации финансовых рисков и их основные проявления. 6. Риски утраты ликвидности (платежеспособности). 7. Виды инвестиционных рисков и рисков, связанных с покупательной способностью денег. 8. Понятие интегрированной системы управления рисками.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		9. Интегральные оценка и характеристики риска. 10.Методы оценки риска: экономико-статистические, математические. ***Практическое задание:*** Предприниматель предполагает построить клуб неподалеку от университета. По одному из допустимых проектов предприниматель может в дневное время открыть в здании дискотеки столовую для студентов и преподавателей, Другой вариант не связан с дневным обслуживанием клиентов. Представленные бизнес-планы показывают, что план, связанный со столовой, может принести доход в 250 тыс. руб. Без открытия столовой бизнесмен может заработать 175 тыс. руб. Потери в случае открытия дискотеки со столовой составят 55 тыс. руб., а без столовой- 20 тыс. руб. Определите наиболее эффективную альтернативу на основе средней стоимостной ценности в качестве критерия. Определите сопутствующие риски.
ПК-5.2	Осуществляет стратегическое регулирование, контроль и аудит внедрения интегрированной системы управления рисками	**Темы курсовых работ:** 1.Страхование как способ управления финансовыми рисками. 2. Способы снижения финансовых рисков. 3. Внутренние механизмы нейтрализации рисков. 4. Финансовое состояние предприятия и риск банкротства. 5. Риск и доходность финансовых активов. 6. Инвестиционные риски: виды, управление и оценка. 7. Риск несбалансированной ликвидности, его проявление и признаки. 8. Банковские риски: сущность, виды и управление. Их контроль. 9.Классификация методов управления рисками. 10. Суть диверсификации риска. 11. Сущность, преимущества и недостатки страхования. 12. Сущность, преимущества и недостатки хеджирования. 13. Сущность, преимущества и недостатки лимитирования. 14. Сущность, преимущества и недостатки самострахования. 15. Процесс оценки эффективности управления риском. **Ситуационное задание:** Определите риски и обоснуйте выбор. При вложении капитала в проект типа ≪А≫ из 200 случаев прибыль 25 млн. руб. была получена в 20 случаях, прибыль в 30 млн. руб. – в 80 случаях, прибыль 40 млн. руб. – в 100 случаях. При вложении капитала в проект типа ≪Б≫ из 240 случаев прибыль 30 млн. руб. была получена в 144 случаях, прибыль в 35 млн. руб. – в 72 случаях, прибыль 45 млн. руб. – в 24 случаях. Критерием выбора является наибольшая сумма средней прибыли.

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td colspan="3">Производственная – научно-исследовательская работа</td></tr>
<tr><td>ПК-5.1</td><td>Разрабатывает и внедряет методологические основы интегрированной системы управления рисками</td><td rowspan="2">Практические задания:
1. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов исследования научному сообществу.
2. Подготовка и оформление рукописи выпускной квалификационной работы.</td></tr>
<tr><td>ПК-5.2</td><td>Осуществляет стратегическое регулирование, контроль и аудит внедрения интегрированной системы управления рисками</td></tr>
<tr><td colspan="3">Производственная – преддипломная практика</td></tr>
<tr><td>ПК-5.1</td><td>Разрабатывает и внедряет методологические основы интегрированной системы управления рисками</td><td rowspan="2">Задание на практику:
– подготовить рекомендации по развитию применяемых финансовых технологий и совершенствованию системы управления рисками (рекомендации должны быть обоснованными, т.е. сопровождаться ссылками на соответствующие нормативно-правовые акты или авторитетное мнение специалистов в сфере деятельности, исследователей, конкурентов, потребителей и т.п.);
– подготовить выводы о деятельности предприятий или организаций, в области применения финансовых технологий и управления рисками, а также практические рекомендации по совершенствованию организационных и экономических аспектов их деятельности в условиях неопределенности;
– систематизировать и обобщить материалы для написания выпускной квалификационной работы;
– составить отчет по практике и подготовить его к защите</td></tr>
<tr><td>ПК-5.2</td><td>Осуществляет стратегическое регулирование, контроль и аудит внедрения интегрированной системы управления рисками</td></tr>
<tr><td colspan="3">ПК-6: Способен методически обеспечивать, поддерживать и координировать процесс управления рисками</td></tr>
<tr><td colspan="3">Риски и финансовый контроль в бизнесе</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
ПК-6.1	Организует и координирует деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации	***Перечень теоретических вопросов к зачету:*** 1. Сущность, роль и функции контроля в управлении экономикой. Виды контроля. 2. Взаимосвязь и отличия внешнего и внутреннего контроля, внутреннего управленческого контроля и ревизии. 3. Сущность и функции финансового контроля, его практическая значимость. 4. Основные задачи и направления внешнего финансового контроля. 5. Внешний финансовый контроль. Подготовка, планирование, проведение и оформление результатов внешнего контроля. 6. Внутренний финансовый контроль в организации. Основные задачи и направления внутреннего финансового контроля. 7. Ревизия как инструмент контроля. Задачи и организация проведения ревизии. 8. Основания и периодичность проведения ревизии. Направления ревизионной проверки, оценка и анализ бизнес-рисков. 9. Финансовый мониторинг как система наблюдений за финансовым состоянием бизнес-структуры. Идентификация, оценка и анализ рисков. 10. Внутренний финансовый контроль и внутрихозяйственный расчет бизнес-структур. Бюджетирование. 11. Внутренний финансовый контроль и система мер по разграничению риска хозяйственной деятельности. 12. Внутренний финансовый контроль: порядок проверки смет (бюджетов), центров затрат, ответственности и организации бюджетирования. Управление риском. 13. Контрольные органы исполнительной власти. 14.Валютный контроль. Оценка, анализ и управление финансовыми рисками в системе валютного контроля
ПК-6.2	Разрабатывает и обосновывает рекомендации по совершенствованию системы/процесса управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации	***Примерные практические задания для зачета:*** <u>Задача № 1</u>. Бизнес-структура, производящая вычислительную технику, провела анализ рынка нового высокопроизводительного персонального компьютера. Если будет выпущена крупная партия компьютеров, то при благоприятном рынке прибыль составит 350 тыс. руб., а при неблагоприятных условиях бизнес-структура понесет убытки в 190 тыс. руб. Небольшая партия техники в случае ее успешной реализации принесет бизнес-структуре 50 тыс. руб. прибыли и 10 тыс. руб. убытков – при неблагоприятных внешних условиях. Вероятность благоприятного и неблагоприятного исходов оценивается одинаково. Используйте дерево решений для того, чтобы помочь бизнес-структуре выбрать правильную технико-экономическую стратегию. Ответьте на следующие вопросы: - следует ли заказывать эксперту дополнительное обследование рынка; - какую максимальную сумму можно выплатить эксперту за проделанную работу; - какова ожидаемая денежная оценка наилучшего решения. <u>Задача № 2</u>. При использовании новых форм сбыта продукции бизнес-структура при продаже 80 единиц получило прибыль в размере 25 000 ден. ед., при продаже 60 единиц – 30 000 ден. ед., а при продаже еще 60 единиц – 20 тыс. ден. ед. Всего было реализовано 200 единиц продукции. В то же время при продаже продукции в традиционной форме прибыль в размере 25 тыс. ден. ед. была получена в 60 случаях из 200, в размере 30 тыс. ден. ед. – в 75 случаях и в размере 20 тыс. ден. ед. – в 65 случаях. Выясните, целесообразен ли переход на новые формы сбыта. <u>Задача № 3</u>.

<table>
<tr><th>Код индикатора</th><th>Индикатор достижения компетенции</th><th>Оценочные средства</th></tr>
<tr><td></td><td></td><td>Рассчитайте показатель риска и выберите наименее рисковый вариант вложения капитала.
Составьте алгоритм анализа рисковой ситуации.
<table>
<tr><th rowspan="2">Показатели</th><th colspan="2">Вариант вложения капитала</th></tr>
<tr><th>первый</th><th>второй</th></tr>
<tr><td>Собственные средства, тыс. руб.</td><td>20 000</td><td>100 000</td></tr>
<tr><td>Максимально возможная сумма убытка, тыс. руб.</td><td>11 000</td><td>31 000</td></tr>
</table>
<u>Задача № 4</u>.
Рассматриваются два варианта вложения капитала. При первом варианте прибыль составляет 15 млн. руб., убыток – 4 млн. руб. По второму варианту прибыль составляет 18 млн. руб., а убыток – 5 млн. руб.
Выясните, какой показатель позволит принять решение по выбору направления вложения капитала.
Определите наименее рискованный вариант вложения капитала и направления его реализации.</td></tr>
<tr><td colspan="3">Риски предпринимательской деятельности</td></tr>
<tr><td>ПК-6.1</td><td>Организует и координирует деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации</td><td>Перечень теоретических вопросов к зачету:
1. Понятие финансового предпринимательства. Характеристика факторов макросреды финансового предпринимательства.
2. Характеристика факторов микросреды финансового предпринимательства.
3. Риск как экономическая категория. Условия определенности и неопределенности.
4. Характеристика предпринимательского риска.
5. Виды рисков, основные элементы классификации рисков.
6. Основные причины и источники хозяйственного риска.
7. Внешние и внутренние предпринимательские риски.
8. Стратегия управления предпринимательскими рисками.
9. Основные задачи и принципы управления риском.
10. Политика (этапы) управления риском.
11. Основные условия избежания риска.
12. Основные методы системы внутренних механизмов нейтрализации рисков.
13. Статистические методы принятия решений в условиях риска.
14. Сценарный подход к оценке риска.
15. Метод чувствительности в оценке риска.
16. Метод «дерево решений» в оценке риска.
17. Экспертный метод оценки риска.
18. Метод Дельфи.</td></tr>
</table>

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		19. Оценка степени риска в условиях определенности. 20. Классификация финансовых рисков. 21. Риски развития, процентные риски. Характеристика. 22. Анализ кредитных рисков. 23. Оценка риска на основе финансовой отчетности. 24. Совокупный предпринимательский риск и методы его оценки. 25. Риск инвестиций. Характеристика. 26. Валютные риски, меры по снижению валютных рисков. 27. Общая схема процесса управления риском. 28. Диверсификация как метод снижения риска. 29. Сущность страхования риска. 30. Хеджирование, основные понятия. 31. Опционы. Отличие страхования от хеджирования. 32. Лимитирование средств, самострахование как методы снижения риска. 33. Основные решения снижения риска. 34. Коэффициент бета. Премия за риск.
ПК-6.2	Разрабатывает и обосновывает рекомендации по совершенствованию системы/процесса управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации	***Примерные практические задания для зачета:*** **Задание 1.** Правильно ли оценены ценные бумаги, если ставка свободная от риска составляет 8%.Доходность акций компании А оценивается в 16,1%, акций В – 22,4%. Бета акций А- 0,9, бета акций В- 1,6. **Задание 2.** Применяя метод анализа чувствительности, определите чувствительность проекта к изменению объема производства и цене изделия. Исходные данные. Инвестор решает вопрос об инвестировании 570 тыс.рублей в проект. Объем производства и реализации продукции при реализации проекта составит 1500 изделий в месяц. Цена реализации одного изделия – 480 рублей, себестоимость единицы – 290 рублей.Диапазон изменения параметров -80%, 90%, 100%, 110%, 120%. Оценку эффективности проекта произвести за 10 периодов. **Задание 3.** Применяя метод анализа чувствительности, определите чувствительность проекта к изменению объема производства и цене изделия. Исходные данные. Инвестор решает вопрос об инвестировании 570 тыс.рублей в проект. Объем производства и реализации продукции при реализации проекта составит 1500 изделий в месяц. Цена реализации одного изделия – 480 рублей, себестоимость единицы – 290 рублей. Диапазон изменения параметров -80%, 90%, 100%, 110%, 120%. Оценку эффективности проекта произвести за 10 периодов. **Задание 4.** Фирма планирует построить среднее или малое предприятие по производству продукции. Рассматривается вариант строительства среднего предприятия, или малого предприятия с последующим расширением производства через 2 года, если сформируется высокий спрос на продукцию.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

Фирма рассматривает задачу на 10-летний период. Маркетинговый анализ рынка показал, что вероятность высокого спроса – 0,65%, низкого спроса – 35%.

Инвестиции в строительство среднего предприятия – 7,5 млн. руб. Инвестиции в малое предприятие – 1,8 млн. руб., затраты на его дальнейшее расширение – 3,4 млн. руб.

Ожидаемые ежегодные доходы:

По среднему предприятию: при высоком спросе – 1,4 млн.руб., при низком – 0,38 млн. руб. ежегодно в течение 10 лет.

По малому предприятию: при высоком спросе – 0,27 млн.руб., при низком – 0,25 млн. руб. ежегодно в течение 2 лет.

После расширения малого предприятия: при высоком спросе – 1,6 млн.руб., при низком – 0,24 млн. руб. ежегодно в течение 8 лет.

Без расширения малого предприятия: при высоком спросе –0,27 млн.руб., при низком – 0,20 млн. руб. ежегодно в течение 8 лет.

На основе «дерева решений» выбрать предпочтительный вариант инвестирования.

Задание 5. Рассчитать совокупный предпринимательский риск компании.

Ежегодно производится 100 тыс. единиц продукции. Цена реализации составляет 3500 рублей, средние переменные издержки составляют 1800 руб/шт. Постоянные издержки – 38500 тыс.руб.

Величина собственного капитала организации составляет 800 тыс.руб. Сумма заемных источников – 550 тыс. руб. Средняя процентная ставка по кредитам – 14,5 %. Ставка налога на прибыль – 20%.

Задание 6. Предложены следующие варианты сценариев реализации предпринимательских проектов.

Таблица 3.3

Сценарии реализации предпринимательских проектов

Состояние экономики	Вероятность наступления данного состояния	Проект C, IRR, %	Проект D, IRR.%
подъем	0,4	45	125
норма	0,3	38	75
спад	0,3	15	20

Примерный перечень тем комплексной исследовательской работы:

1. Совершенствование инструментов стратегического планирования в риск-менеджменте организации.
2. Оптимизация рисков структурных преобразований в промышленности (банковской сфере, страховой деятельности).
3. Совершенствование системы оценки и страхования рисков промышленного предприятия.
4. Совершенствование системы оценки и страхования рисков коммерческого банка (страховой компании, инвестиционной компании).
5. Разработка методов и инструментов повышения энергетической безопасности и экономически устойчивого развития предприятий топливно-энергетического комплекса России.
6. Исследование рисковых аспектов инновационной политики в условиях предприятий топливно-энергетического комплекса.
7. Исследование рисковых аспектов инновационной политики в условиях предприятий машиностроительного комплекса.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		8. Исследование рисковых аспектов инновационной политики в условиях предприятий металлургического комплекса. 9. Оптимизация рисков промышленной компании на основе формирования систем контроллинга. 10. Совершенствование методики оценки инновационных рисков промышленного предприятия. 11. Совершенствование методов (инструментов, механизмов) оптимизации рисков венчурных организаций. 12. Разработка методов (инструментов) оценки инновационного потенциала организации в системе риск-менеджмента.
Рискология		
ПК-6.1	Организует и координирует деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации	*Перечень теоретических вопросов к зачету и экзамену:* 1. Инструментарий теории игр и возможности его применения в оценке и анализе рисков. 2. Инструментарий методики дерева решений и возможности его применения в оценке и анализе рисков. 3. Инструментарий анализа чувствительности и возможности его применения в оценке и анализе рисков. 4. Инструментарий метода аналогий и возможности его применения в оценке и анализе рисков. 5. Новые возможности оценки рисков на основе методов теории вероятностей и математической статистики 6. Особенности формирования вторичных рисков в системе риск-менеджмента инструментарий управления вторичными рисками организации. ***Примерные практические задания для зачета и экзамена:*** ***Задача № 1.*** Компания А доминирует на рынке некоторого товара. Компания В изучает риски выхода на рынок этого товара. При этом рассматриваются две стратегии компании В: стратегия B_1 – выходить на рынок, стратегия B_2 – не выходить на рынок. В свою очередь, компания А решает, стоит ли ей снижать объемы производства этого товара, рассматривая при этом две стратегии: стратегия A_1 – сохранить объемы производства, стратегия A_2 – снизить объемы производства. Используя метод дерева решений дать для каждой альтернативы ожидаемую стоимостную оценку EMV. Схема принятия стратегического решения может быть представлена в виде рисунка 1.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

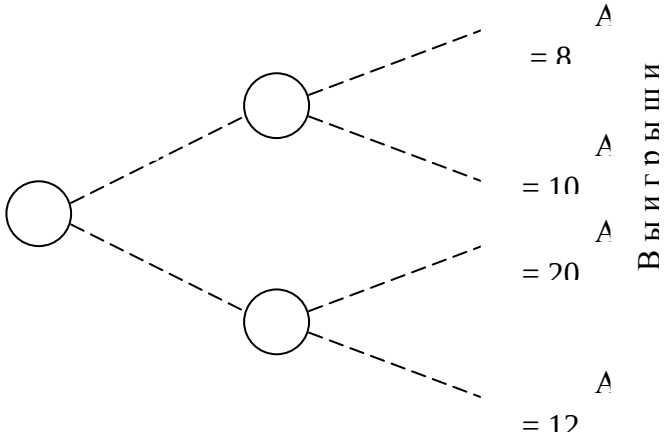


Рисунок 1 – Схема матричной игры с выходом компании В на рынок (метод дерева решений)

Задача № 2.

Используя показатели математического ожидания и стандартного отклонения для оценки риском сравнить варианты инвестиционного проекта № 1 и 2, для которых известны, соответственно, возможные значения валовой прибыли $x_1,\ldots,x_n$, а также вероятности получения валовой прибыли $p_1,\ldots,p_n$ (таблица 1).

Таблица 1 – Объема и вероятность получения валовой прибыли по вариантам проекта

Показатель	Период, годы					
	1	2	3	4	5	6
Объем прибыли, млр . руб.	-2	-1	0	1	2	3
Вероятность (вариант 1)	0,1	0,1	0,3	0,2	0,3	0
Вероятность (вариант 2)	0,1	0,2	0,1	0,2	0,2	0,2

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

Для каждого варианта вычисляется математическое ожидание $M(X)=\sum_{i=1}^{n} p_i \cdot x_i$ (характеризует средний уровень валовой прибыли) и стандартное отклонение $\sigma(X)=\sqrt{\sum_{i=1}^{n} p_i x^2 - [M(X)]^2}$ (оценка риска проекта).

Полученные расчетом данные сводятся в таблицу 2.

Таблица 2 – Результаты оценки риска инвестиционного проекта

Валовая прибыль x_i	Вариант 1			Вариант 2		
	p	$p \cdot x$	$px \cdot x = p \cdot x^2$	p	$p \cdot x$	$px \cdot x = p \cdot x^2$
-2	0,1	-0,2	0,4	0,1	-0,2	0,4
-2	0,1	-0,1	0,1	0,2	-0,2	0,2
0	0,3	0	0	0,1	0	0
1	0,2	0,2	0,2	0,2	0,2	0,2
2	0,3	1,2	1,2	0,2	0,4	0,8
3	0	0	0	0,2	0,6	1,8
Сумма	1	0,5	1,9	1	0,8	3,4

В варианте 1 проекта прибыль выше, но и оценка риска также выше.

Направления исследований для зачета и экзамена:

1. Методы теории игр и возможности их использования в анализе рисков.
2. Методы дерева решений: возможности развития инструментария риск-менеджмента.
3. Методы анализа чувствительности: возможности развития инструментария риск-менеджмента.
4. Возможности метода аналогий в идентификации, оценке и анализе рисков.
5. Развитие инструментария оценки рисков на основе методов теории вероятностей и математической статистики
6. Вторичные риски как фактор неопределенности в управлении риском.
7. Инструментарий теории игр и возможности его применения в оценке и анализе рисков.
8. Инструментарий методики дерева решений и возможности его применения в оценке и анализе рисков.
9. Инструментарий анализа чувствительности и возможности его применения в оценке и анализе рисков.
10. Инструментарий метода аналогий и возможности его применения в оценке и анализе рисков.
11. Новые возможности оценки рисков на основе методов теории вероятностей и математической статистики
12. Особенности формирования вторичных рисков в системе риск-менеджмента инструментарий управления

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		вторичными рисками организации. 13. Особенности оценки рисков с использованием методологии финансового анализа. 14. Интегрированный риск-менеджмент и критика фрагментарного риск-менеджмента.. 15. Карта рисков. Особенности когнитивного подхода в идентификации и управлении рисками. 16. Рисковая ситуация как инструмент анализа поля рисков современной организации.
ПК-6.2	Разрабатывает и обосновывает рекомендации по совершенствованию системы/процесса управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации	***Перечень теоретических вопросов к зачету и экзамену:*** 1. Углубление исследования рисков на основе немарковских процессов. 2. Недостатки вероятностного подхода к оценке рисков и требование детерминированности входных параметров. 3. Введение понятия субъективных неклассических (аксиологических) вероятностей, не имеющих частотного смысла и выражающих познавательную активность исследователя случайных процессов. 4. Модифицированный интервально-вероятностный метод Гурвица и учет информацию о соотношении вероятностей сценариев. 5. Принцип Гиббса-Джейнса: среди всех вероятностных распределений показателя рекомендуется выбирать то, которому отвечает наибольшая энтропия. 6. Имитационное моделирование по методу Монте-Карло как дальнейшее развитие метода сценариев в оценке рисков. 7. Перспективы использования нечеткой логики и аппарата теории нечетких множеств в исследовании рисков. 8. Концепция ограниченного риска. Метод стоимости риска VAR (Value-at-Risk). 9. Приемы управления рисков в системе риск-менеджмента: избежание риска, удержание риска, передача риска, снижение степени риска. 10. Управление рисками на основе методов диверсификации, лимитирования, страхования. 11. Управление рисками на основе приобретения дополнительной информации и методов самострахования. 12. Экспертное исследование рисков: Дельфийский метод и метод парных корреляций. 13. Отбор экспертов для исследования рисков и возможности снижения вторичных рисков. 14. Алгоритм экспертного оценивания рисков и коэффициент конкордации Кендалла-Смита. 15. Развитие вероятностного подхода на основе аксиологических вероятностей, выражающих познавательную активность исследователя рисков. 16. Методика имитационного моделирования по методу Монте-Карло в оценке рисков и развитие метода сценариев. 17. Слабоструктурированные системы и управление рисками с использованием нечеткой логики. 18. Функции принадлежности в нечетко-множественных описаниях: точечная, интервальная, трапециевидная, треугольная, в виде гауссианы, в виде S –функции. 19. Содержание понятия лингвистической переменной в нечеткой логике. ***Примерные практические задания для зачета и экзамена:*** ***Задача № 1.*** Компания использует несколько каналов сбыта продукции промышленной компании определенного ассортимента на внутреннем рынке. На основе анализа маркетинговых исследований рынка были обобщены следующие сведения:

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

- прогнозный годовой объем сбыта продукции с гарантированным, устойчивым уровнем сбыта на ряд лет (с низкой зависимостью от резких изменений рыночной конъюнктуры) W_1;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции с устойчивым уровнем сбыта на ближайший год, не на длительный срок (средняя зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_2;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции, обеспечиваемый только разовыми поставками (высокая зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_3;
- прогнозный годовой объем сбыта продукции, покупатель на которую строго не определен (абсолютная зависимость от изменений конъюнктуры рынка) W_4.

Таким образом, общий прогнозный годовой объем сбыта определенной продукции рассматриваемого предприятия, основанный на маркетинговом анализе конъюнктуры рынка, составляет $\Sigma W_j = W_1 + W_2 + W_3 + W_4$.

В рамках маркетинговых исследований также определены четыре стратегии производства и реализации той же продукции в условиях предприятия:

- стратегия сбыта S_1 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом _____ млн. рублей;
- стратегия сбыта S_2 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом _____ млн. рублей;
- стратегия сбыта S_3 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом _____ млн. рублей;
- стратегия сбыта S_4 предполагает производство и реализацию продукции годовым объемом _____ млн. рублей.

Все необходимые данные по всем W_j и S_i представлены ниже, в таблице 1. Используя методы теории игр, результаты расчетов по критериям Вальда, Сэвиджа и Гурвица, обосновать выбор стратегии финансирования сбыта компании в задаваемых условиях конъюнктуры рынка.

Таблица 1 – Данные для оценки вариантов финансирования реализации продукции

Объем производства продукции S_i, млн. руб.		Прогнозная валовая прибыль в зависимости от конъюнктуры рынка ΣW_j, млн. руб.			
		4000	6000	10000	13000
S_1	5000	1620	2252	2252	2252
S_2	8000	– 2498	1767	2967	2967
S_3	11000	– 4025	-1083	3115	3844
S_4	13000	– 7383	-3430	1683	5107

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

Задача № 2.

На основе использования современных методов финансового и факторного анализа выявить ключевые факторы стратегического и тактического риска и оценить уровень капитализации промышленной компании по показателю темпа роста собственного капитала компании $q_{собств}$: $q_{собств} = P_{об} \cdot O_{кап} \cdot M_{кап} \cdot d_{реинв}$; $q_{собств} = \frac{Пр_{реинв}}{К_{собств}}$; $P_{об} = \frac{Пр_{чист}}{О_{реал}}$; $O_{кап} = \frac{О_{реал}}{К_{общ}}$; $M_{кап} = \frac{К_{общ}}{К_{собств}}$; $d_{реинв} = \frac{Пр_{реинв}}{Пр_{чист}}$. где $P_{об}$ - рентабельность оборота; $O_{кап}$ - оборачиваемость капитала; $M_{кап}$ - мультипликатор капитала; $d_{реинв}$ - доля отчислений чистой прибыли на развитие производства; $Пр_{реинв}$ - реинвестированная (капитализированная) прибыль компании, руб.; $К_{собств}$ - собственный капитал, руб.; $Пр_{чист}$ - чистая прибыль организации, руб.; $О_{реал}$ - выручка от реализации, руб.; $К_{общ}$ - общая сумма капитала организации (собственного и заемного), руб.

Исходная информация для расчетов представлена в таблице 1 и характеризуют состояние активов и пассивов компании по состоянию на конец 2015 и 2016 гг. (по данным бухгалтерской отчетности компании).

Таблица 1 – Исходные данные для оценки финансового состояния промышленной компании по состоянию на конец 2015 и 2016 гг., млн. руб.

Наименование показателей	**Вариант - 1**		**Вариант - 2**	
	2015	2016	2015	2016
ВНЕОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ				
1. Нематериальные активы	282	704	171	263
2. Основные средства	32108	39430	38022	40537
3. Незавершенное строительство	221	176	103	83
4. Доходные вложения в материальные ценности	398	542	102	146
5. Долгосрочные финансовые вложения	610	388	404	363
6. Прочие внеоборотные активы	49	80	34	72
Итого по разделу I	33668	41320	38836	41464
в т.ч. неходовые материальные ценности	31	33	28	25
ОБОРОТНЫЕ АКТИВЫ				
1. Запасы:	21773	23078	23078	26006
- сырье, материалы и др.	19383	20046	19023	21516

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*				
		- затраты в незавершенном производстве - готовая продукция и товары для продажи - товары отгруженные - расходы будущих периодов - прочие запасы	314 2029 15 26 6	368 2618 12 28 6	892 3100 32 27 4	917 3499 34 33 7
		2. НДС по приобретенным ценностям	3179	3259	3620	3872
		3. Дебиторская задолженность (платежи более чем через 12 месяцев после отчетной даты)	1 055	843	522	501
		в т.ч. покупатели и заказчики	–	–	–	–
		4. Дебиторская задолженность (платежи в течение 12 месяцев после отчетной даты)	16377	18400	12484	14501
		в т.ч. покупатели и заказчики	4410	4687	3322	2607
		5. Авансы выданные	883	946	760	502
		6. Прочие дебиторы	1063	1256	1022	1053
		7. Краткосрочные финансовые вложения	4082	3892	1855	1925
		8. Денежные средства	166	150	364	387
		9. Прочие оборотные активы	–	–	–	–
		Итого по разделу II	48578	51824	43705	48747
		Итого активов	82246	93144	82541	90211
		КАПИТАЛ И РЕЗЕРВЫ				
		1. Уставный капитал	21750	21750	25550	25550
		2. Добавочный капитал	983	1050	1222	1309
		3. Резервный капитал	5834	5834	6699	6753
		4. Нераспределенная прибыль	2866	7025	6975	10336
		Итого по разделу III	31433	35659	40446	43948
		ДОЛГОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА				
		1. Займы и кредиты	14255	16810	10093	11092
		2. Прочие долгосрочные обязательства	303	450	352	288
		Итого по разделу IV	14558	17260	10445	11380
		КРАТКОСРОЧНЫЕ ОБЯЗАТЕЛЬСТВА				
		1. Займы и кредиты	21734	25629	18840	21045
		2. Кредиторская задолженность:	12937	12740	11187	12528

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*

- поставщики и подрядчики - задолженность перед персоналом - задолженность перед государственными внебюджетными фондами - задолженность по налогам и сборам	11711 389 109 728	11375 376 102 887	10286 333 93 475	11509 377 105 537
3. Авансы полученные	772	990	780	593
4. Прочие кредиторы				
5. Задолженность перед учредителями по выплате доходов	–	–	–	–
6. Доходы будущих периодов	812	866	843	717
7. Резервы предстоящих расходов	–	–	–	–
8. Прочие краткосрочные обязательства	–	–	–	–
Итого по разделу V	36255	40225	31650	34883
Итого пассивов	82246	93144	82541	90211
Выручка от реализации продукции	41178	45633	40989	44878
Чистая прибыль компании	6835	9822	9118	8327
Величина реинвестируемой чистой прибыли	3465	3922	3198	3477

Проанализировать полученные результаты, сделать необходимые выводы об уровне капитализации компании, темпах роста собственного капитала компании, ключевых факторах риска. Выявить изменения в финансовом состоянии промышленной компании, произошедшие в течение календарного 2015 года. Разработать рекомендации по совершенствованию финансово-хозяйственной деятельности промышленной компании и снижению уровня угроз ее бизнесу.

Направления исследований для зачета и экзамена:

1. Слабоструктурированные системы и классификация нечетких объектов по виду функции принадлежности.
2. Аттрактор как характеристика функции принадлежности: точечная, интервальная, трапециевидная, треугольная, в виде гауссианы, в виде S –функции.
3. «Смысл» и «гибрид» как содержание понятия лингвистической переменной в нечеткой логике.
4. Итерационный алгоритм оценки риска на основе аппарата теории нечетких множеств.
5. Сравнительный анализ исследования рисков на основе марковских и немарковских процессов.
6. Математическая статистика и вероятностный подход к оценке рисков: требование детерминированности исходной информации.
7. Развитие вероятностного подхода на основе аксиологических вероятностей, выражающих познавательную активность исследователя рисков.
8. Методика имитационного моделирования по методу Монте-Карло в оценке рисков и развитие метода сценариев.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		9. Нечеткая логика и теория нечетких множеств: перспективы применения в исследовании рисков.
Стратегический менеджмент		
ПК-6.1	Организует и координирует деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации	1. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЕ ВАРИАНТЫ*** ОТВЕТОВ УКАЖИТЕ ЦЕЛИ И МЕТОДОЛОГИЮ СТРАТЕГИЧЕСКОГО ПЛАНИРОВАНИЯ 1. Достижение долговременного конкурентного преимущества на основе использования сильных сторон и компенсации слабостей компании Расчет результатов деятельности и потребности в ресурсах на длительный период 2. От настоящего к будущему 3. Повышение адаптационной способности компании, ее устойчивости под действием внешней среды 4. От будущего к настоящему и обратно в будущее 5. Оптимизация расхода ресурсов на основе применения моделей 6. Рентабельность, прибыльность 7. Поиск возможностей и разработка методов влияния на рыночную ситуацию в выгодном для себя свете 2. УКАЖИТЕ ***НЕПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА К ЧИСЛУ ОСНОВНЫХ ХАРАКТЕРИСТИК ЦЕЛЕЙ ОТНОСЯТ: 1. Реалистичность 2. Максимизация прибыли 3. Конкретность 4. Измеримость 5. Непротиворечивость 6. Горизонт планирования 3. УКАЖИТЕ ***НЕПРАВИЛЬНЫЕ ВАРИАНТЫ*** ОТВЕТОВ ТРАДИЦИОННО, СЧИТАЕТСЯ, ЧТО В МИСИИ ОРГАНИЗАЦИИ ДОЛЖНЫ НАЙТИ ОТРАЖЕНИЕ СЛЕДУЮЩИЕ ПОЗИЦИИ: 1. Потребители 2. Продукция (услуги) 3. Рынки 4. Широкие экономические задачи фирмы 5. Философия 6. Самооценка 7. Забота об имидже 8. Оценка угроз 9. Оценка возможностей

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		4. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЕ ВАРИАНТЫ*** ОТВЕТОВ ЦЕЛЕВОЕ НАЗНАЧЕНИЕ СТРАТЕГИИ ДИФФЕРЕНЦИАЦИИ СОСТОИТ В: 1. Ориентации на максимальное снижение издержек по сравнению с конкурентами 2. Придании товару уникальных свойств 3. Ориентации на определенный географический регион 4. Обеспечении большей потребительской ценности товара по отношению к товару конкурентов 3. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЕ ВАРИАНТЫ*** ОТВЕТОВ ЦЕЛЕВОЕ НАЗНАЧЕНИЕ СТРАТЕГИИ ФОКУСИРОВАНИЯ СОСТОИТ В: 1. Ориентации на покупателей со специфическими потребностями 2. Ориентации на повышение качества товара 3. Ориентации на определенный географический регион 4. Ориентации на повышение качества обслуживания 5. Обеспечении большей потребительской ценности товара по отношению к товару конкурентов 5. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА НА СТАДИИ ЗРЕЛОСТИ ОТРАСЛИ ПОЛИТИКА В ОТНОШЕНИИ ПОКУПАТЕЛЕЙ ПРЕДПОЛАГАЕТ: 1. Привлечение новых сегментов покупателей за счет последовательного снижения цен, демонстрации новых возможностей использования товара 2. Поддержание интереса к товарам и услугам, их привлекательного имиджа 3. Предложение сопутствующих товаров и дополнительных услуг, новых вариантов использования товара 6. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЙ ВАРИАНТ*** ОТВЕТА НА СТАДИИ РАЗВИТИЯ ОТРАСЛИ, ТОВАРНАЯ СТРАТЕГИЯ ОРГАНИЗАЦИИ ПРЕДПОЛАГАЕТ: 1. Расширение потребительских свойств, совершенствование дизайна товара 2. Обновление и адаптация товара к происходящим изменениям 3. Сокращение товарных групп и моделей товаров, увеличение объемов продаж 4. Отчетливую дифференциацию за счет улучшение качества и обновление товара 7. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЕ ВАРИАНТЫ*** ОТВЕТОВ «ПАРТИЗАНСКАЯ ВОЙНА» ПРЕДПОЛАГАЕТ: 1. Предложение аналогичного по качеству товара по более низкой цене 2. Придание товару новых потребительских свойств 3. Сооружение новых производственных мощностей в непосредственной близости от заводов конкурента 4. Расширение ассортимента товаров (создание аналогов каждого товара конкурента) 5. Неожиданное резкое снижение цен

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		6. Предложение больших скидок в течении короткого промежутка времени 7. Проведение специальных компаний по отвлечению потребителей от конкурентов (сокращение сроков поставок, технические консультации и т.д.) 8. Привлечение потребителей конкурентов, чья продукция не отличается высоким качеством, свойствами и экономичностью 9. Атака на конкурентов со слабой торговой маркой 10. Работа с теми сегментами, которые соперник не хочет или не может обслуживать 8. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЕ ВАРИАНТЫ*** ОТВЕТОВ СТРАТЕГИЯ ИНТЕГРИРОВАННОГО РОСТА ВЫРАЖАЕТСЯ В: 1. Создании новых производств, совпадающих с профилем организации 2. Освоении выпуска новых продуктов, не совпадающих с традиционным профилем организации 9. Освоении новых непрофильных продуктов для традиционных потребителей организации 4. Стремлении увеличить свою долю на традиционных рынках 5. Введении своего продукта на рынок в новых географических условиях 6. Стремлении увеличить объем реализации через улучшение или модификацию своего продукта 7. Приобретении в собственность или установление полного контроля над распределительной сетью 8. Стремлении получить в собственность или под полный контроль поставщиков сырья 9. Стремлении получить в собственность или под полный контроль своих конкурентов 9. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЕ ВАРИАНТЫ*** ОТВЕТОВ СТРАТЕГИЯ КОНЦЕНТРИРОВАННОГО РОСТА ВЫРАЖАЕТСЯ В: 1. Стремлении увеличить свою долю на традиционных рынках 2. Введении своего продукта на рынок в новых географических условиях 3. Стремлении увеличить объем реализации через улучшение или модификацию своего продукта 4. Приобретении в собственность или установление полного контроля над распределительной сетью 5. Стремлении получить в собственность или под полный контроль поставщиков сырья 6. Стремлении получить в собственность или под полный контроль своих конкурентов 7. Создании новых производств, совпадающих с профилем организации 8. Освоении выпуска новых продуктов, не совпадающих с традиционным профилем организации 9. Освоении новых непрофильных продуктов для традиционных потребителей организации 10. УКАЖИТЕ ***ПРАВИЛЬНЫЕ ВАРИАНТЫ*** ОТВЕТОВ СТРАТЕГИЯ ДИВЕРСИФИЦИРОВАННОГО РОСТА ВЫРАЖАЕТСЯ В: 1. Стремлении увеличить свою долю на традиционных рынках 2. Введении своего продукта на рынок в новых географических условиях

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		3. Стремлении увеличить объем реализации через улучшение или модификацию своего продукта 4. Приобретении в собственность или установление полного контроля над распределительной сетью 5. Стремлении получить в собственность или под полный контроль поставщиков сырья 6. Стремлении получить в собственность или под полный контроль своих конкурентов 7. Создании новых производств, совпадающих с профилем организации 8. Освоении выпуска новых продуктов, не совпадающих с традиционным профилем организации 9. Освоении новых непрофильных продуктов для традиционных потребителей организации
ПК-6.2	Разрабатывает и обосновывает рекомендации по совершенствованию системы/процесса управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации	**11. Практические работы** **12. Разработка миссии организации** **Задание:** 1. Сформулировать миссию организации как утверждение, раскрывающее смысл ее существования, отличие от подобных ей организаций (узкая трактовка миссии) и в широком понимании (как философию и предназначение организации). 2. Сопоставить содержание миссии с приведенной в теоретической части шаблоном. 3. Разработать вариант шаблона миссии, в соответствии с которым сформулировать миссию организации. **13. Формулировка стратегических целей организации** **Задание:** 1. Сформулировать цели организации с учетом сфер установления целей, направлений установления целей и показателей, позволяющих оценить количественно достижение или недостижение цели. 2. Сформулировать цели по ключевым пространствам достижения цели. 3. На основе изложенных подходов к целеполаганию разработать дерево стратегических целей организации, опираясь на правила осуществления декомпозиции генеральной цели и требований к основным характеристикам **14. Разработка стратегии управления персоналом организации** **Задание**: 1. Провести *SWOT* –анализ по персоналу, опираясь на результаты стратегического анализа организации. 2. Разработать матрицу решений по персоналу. 3. Сопоставить матрицу решений по персоналу с матрицей решений для организации в целом с целью выявления противоречий и рассогласований и их устранения.
Финансовый риск-менеджмент (продвинутый уровень)		
ПК-6.1	Организует и координирует	***Вопросы для экзамена***: 1.Общая характеристика основных факторов и их влияния на изменение уровня финансового риска.

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации	2. Концепция взаимосвязи доходности и риска. 3. Финансовое состояние предприятия и риск банкротства. 4.Опишите экономических агентов выбранного типа рынка. 5.Специфические показатели, используемые для количественной оценки риска: β-коэффициент, точка безубыточности, операционный леверидж, финансовый леверидж, коэффициенты ликвидности и пр. ***Тесты:*** 1.Экономические методы управления рисками включают: а) методы компенсации; б) методы стимулирования; в) методы сдерживания; г) а и б; д) а-в. 2. Управлять риском – это: а) учитывать наличие риска при принятии решений; б) уметь дать риску количественную и качественную оценку; в) владеть методами смягчения или устранения негативных последствий проявления рисковой ситуации; г) осуществлять деятельность, связанную с преодолением неопределенности в ситуации неизбежного выбора, в процессе которой имеется возможность количественно и качественно оценить вероятность достижения предполагаемого результата, неудачи или отклонения от цели; д) а-г; е) а и б. ***Практическое задание:*** При крупном автомобильном магазине планируется открыть мастерскую по предпродажному обслуживанию и гарантийному ремонту автомобилей. Консультационная фирма готова предоставить дополнительную информацию о том, будет ли рынок благоприятным или нет. Эти сведения обойдутся магазину в 13 тыс. руб. Администрация магазина считает, что эта информация гарантирует благоприятный рынок с вероятностью 0,3. Если рынок будет благоприятным, то большая мастерская принесет прибыль в 60 тыс. руб., а маленькая - 30 тыс. руб. При неблагоприятном рынке магазин потеряет 65 тыс. руб., если будет открыта большая мастерская, и 30 тыс. руб. - если откроется маленькая. Не имея дополнительной информации; директор оценивает вероятность благоприятного рынка как 0,6. Положительный результат обследования гарантирует благоприятный рынок с вероятностью 0,8. При отрицательном результате рынок может оказаться благоприятным с вероятностью 0,3. Постройте дерево решений и определите, какова ожидаемая денежная оценка

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
		возможных решений. ***Ситуационные задания:*** 1.Разработайте раздел финансовой политики выбранного предприятия в плане оценки рисков. 2.Оцените риски внутренней и внешней среды выбранного предприятия. Насколько система управления рисками координируется со стратегическими целями предприятия? 3. Напишите эссе об особенностях рисков малого предпринимательства. 4.Напишите эссе об обоснованности применения финансовых рычагов к различным аспектам деятельности предприятия.
ПК-6.2	Разрабатывает и обосновывает рекомендации по совершенствованию системы/процесса управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации	***Вопросы к экзамену:*** 1.Особенности международных стандартов корпоративного управления. 2. Система управления финансовыми рисками. Принципы и ключевые правила управления финансовыми рисками. 3. Общая схема процесса управления риском. 4.Условия формирования эффективной системы риск-менеджмента. 5.Анализ эффективности методов управления финансовыми рисками. 6. Критерии принятия решения в условиях неопределенности. 7. Хеджирование финансовых рисков. 8. Диверсификация рисков как метод снижения их уровня. 9. Лимитирование концентрации финансовых рисков. 10. Страхование и самострахование как методы снижения рисков. ***Ситуационные задания:*** 1. Напишите эссе о сравнении отечественных и международных стандартов корпоративного управления и их влияние на оценку рисков. 2. Оцените специфику ведения бизнеса выбранной организации. Как эта специфика влияет на процесс управления рисками?
Производственная – научно-исследовательская работа		
ПК-6.1	Организует и координирует деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации	**Практические задания:** 1. Используя навыки самостоятельной исследовательской работы, методику и методологию научных исследований, подготовка доклада, тезисов доклада, презентационного материала и пр. по теме исследования с целью представления результатов исследования научному сообществу. 2. Подготовка и оформление рукописи выпускной квалификационной работы
ПК-6.2	Разрабатывает и обосновывает рекомендации по	

Код индикатора	*Индикатор достижения компетенции*	*Оценочные средства*
	совершенствованию системы/процесса управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации	
Производственная – преддипломная практика		
ПК-6.1	Организует и координирует деятельность по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями организации	**Задание на практику:** – подготовить рекомендации по развитию применяемых финансовых технологий и совершенствованию системы управления рисками (рекомендации должны быть обоснованными, т.е. сопровождаться ссылками на соответствующие нормативно-правовые акты или авторитетное мнение специалистов в сфере деятельности, исследователей, конкурентов, потребителей и т.п.); – подготовить выводы о деятельности предприятий или организаций, в области применения финансовых технологий и управления рисками, а также практические рекомендации по совершенствованию организационных и экономических аспектов их деятельности в условиях неопределенности; – систематизировать и обобщить материалы для написания выпускной квалификационной работы; – составить отчет по практике и подготовить его к защите
ПК-6.2	Разрабатывает и обосновывает рекомендации по совершенствованию системы/процесса управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации	