

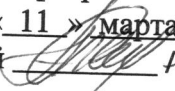
Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Наумова Наталия Александровна
Должность: Ректор
Дата подписания: 24.10.2024 14:21:41
Уникальный программный ключ:
6b5279da4e034bffa679172803da5b7b559fc69e2

МИНИСТЕРСТВО ПРОСВЕЩЕНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования
«ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРОСВЕЩЕНИЯ»
(ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ПРОСВЕЩЕНИЯ)
Экономический факультет
Кафедра финансово-экономического и бизнес-образования

УТВЕРЖДЕН

на заседании кафедры

протокол от « 11 » марта 2024 г., № 8.

Зав. кафедрой  А.И. Власова/

**ФОНД
ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

По учебной дисциплине
Хеджирование ценовых и валютных рисков

Направление подготовки
38.03.01 Экономика

Профиль:
Экономика предприятий и организаций

Квалификация
Бакалавр

Формы обучения
Очная, очно-заочная

Мытищи
2024

1. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы

Код и наименование компетенции	Этапы формирования
СПК-3 «Способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий»	Работа на учебных занятиях Самостоятельная работа

2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Оцениваемые компетенции	Уровень сформированности	Этап формирования	Описание показателей	Критерии оценивания	Шкала оценивания
СПК - 3	Пороговый	1. Работа на учебных занятиях 2. Самостоятельная работа	Знать: -рыночные и специфические риски на товарных и валютном рынках; -структуру управленческих решений; -основные варианты управленческих решений. Уметь: -оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организации; - выделять, формулировать и аргументировать варианты управленческих решений; - обосновать предложения при принятии управленческих решений.	Реферат Рецензия Тест	Шкала оценивания реферата Шкала оценивания рецензии Шкала оценивания теста

	Продвинутый	1. Работа на учебных занятиях 2. Самостоятельная работа	Знать: -рыночные и специфические риски на товарных и валютном рынках; - структуру управленческих решений; - критерии оценки показателя социально-экономической эффективности; особенности рисков и их последствия для социально-экономической составляющей общества. Уметь: -оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организации; - корректно применять знания об управленческих планах; - анализировать возникшие риски и возможные социально-экономические последствия при разработке планов; - выделять, формулировать и аргументировать варианты управленческих решений; -обосновать	Реферат Рецензия Тест	Шкала оценивания реферата Шкала оценивания рецензии Шкала оценивания теста
--	-------------	---	---	--	---

			предложения при принятии управленческих решений; -самостоятельно анализировать различные управленческие решения и прогнозировать социально-экономические последствия развития общественного производства. Владеть: -навыком анализировать поведение участников биржевой торговли; -навыком обосновывать предложения по совершенствованию управленческих решений; - способами управления рисками и выявлять социально-экономические последствия при не рациональном управленческом решении.		
--	--	--	---	--	--

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

Примерный тест

Вариант 1

Тест 1. Акция - это:

1. Долговое обязательство акционерного общества.
2. Срочное обязательство акционерного общества.
3. Документ, подтверждающий право собственности.
4. Бессрочное долговое обязательство акционерного общества.

Тест 2. Фьючерсный контракт - это:

1. Биржевой срочный контракт.
2. Внебиржевой срочный контракт.
3. Биржевой бессрочный контракт.
4. Внебиржевой бессрочный контракт.

Тест 3. Опционный контракт - это:

1. Биржевой срочный контракт с безусловным обязательством его выполнения.
2. Внебиржевой срочный контракт с безусловным обязательством его выполнения.
3. Биржевой бессрочный контракт с безусловным обязательством его выполнения.
4. Внебиржевой бессрочный контракт с безусловным обязательством его выполнения.

Тест 4. Длинный фьючерс - это:

1. Контракт, используемый в шорт-стратегий.
2. Контракт, используемый стратегии на рост
3. Контракт долгосрочный.
4. Контракт среднесрочный.

Тест 5. Короткий фьючерс - это:

1. Контракт, используемый в шорт-стратегий.
2. Контракт, используемый стратегии на рост
3. Контракт долгосрочный.
4. Контракт среднесрочный.

Тест 6. Опцион колл - это:

1. Опцион на продажу.
2. Опцион на покупку.
3. Опцион краткосрочный.
4. Опцион долгосрочный.

Тест 7. Опцион пут - это:

1. Опцион на продажу.
2. Опцион на покупку.
3. Опцион краткосрочный.
4. Опцион долгосрочный.

Тест 8. Вариационная маржа - это:

1. Платеж для удержания позиции.
2. Фиксированное обязательство брокеру.
3. Штраф за досрочное закрытие позиции.
4. Страховка фьючерсного контракта.

Тест 9. Премия опциона - это:

1. Платеж за опцион.
2. Прибыль с опциона.
3. Страховка опциона.
4. Выигрыш за использования опциона.

Тест 10. Хеджирование - это:

1. Спекулятивная стратегия.
2. Страховой продукт.
3. Стратегия биржевой торговли.
4. Защита от волатильности

Примерные вопросы к экзамену

1. Предмет, цели, методология и функции учебного курса.
2. Понятие рынка ценных бумаг, его экономическое и социальное значение.
3. Понятие волатильности и ее причины.
4. Понятие и функции хеджирования ценовых и валютных рисков.
5. Понятие и экономическая роль ценных бумаг.
6. История и виды ценных бумаг.
7. Основные и производные ценные бумаги.
8. Первичные и вторичные ценные бумаги.
9. Понятие «ценной бумаги» в современном законодательстве, ее признаки.
10. Эмитенты ценных бумаг, характеристика и виды.
11. Инвесторы: институциональные и индивидуальные.
12. Понятие рынка ценных бумаг.
13. Экономическая и социальная роль рынка ценных бумаг.
14. Эмитенты, инвесторы и профессиональные участники рынка ценных бумаг.
15. Государственное регулирование рынка ценных бумаг.
16. Долговые ценные бумаги.
17. Имущественные ценные бумаги.
18. Профессиональная деятельность на рынке ценных бумаг, ее виды.
19. Понятие биржевой торговли, история и экономическая функция биржи.
20. Товарная и валютная биржа.
21. Специализированные биржи.
22. Структура управления биржи.
23. Биржевые операции.
24. Торговые платформы.
25. Брокерская деятельность.
26. Биржевой и внебиржевой рынки ценных бумаг.
27. Организационное устройство товарной и фондовой биржи.
28. Организация биржевой торговли и состав ее участников.
29. Управление процессом формирования курса ценных бумаг, их котировка.
30. Биржевые сделки и их виды.
31. Понятие и цели анализа рынка ценных бумаг.
32. Фундаментальный анализ на рынке ценных бумаг.
33. Технический анализ на рынке ценных бумаг.
34. Теории движения цен.
35. Условия хеджирования фьючерсными контрактами.
36. Особенности торговли фьючерсными контрактами.
37. Модели хеджирования фьючерсными контрактами.
38. Условия хеджирования опционными контрактами.
39. Особенности торговли опционными контрактами.
40. Модели хеджирования опционными контрактами.

Примерная тематика рефератов

1. Понятие, сущность, характеристика и роль рисков в управлении предприятием.
2. Современные концепции риска
3. Классификация и системный классификатор рисков
4. Чистые риски
5. Спекулятивные риски
6. Предпринимательские риски
7. Понятие и сущность неопределенности
8. Основные причины неопределенности

9. Виды неопределенностей
10. Соотношение понятий неопределенности и риска
11. Рискообразующие факторы
12. Опасность как рискообразующий фактор
13. Виды опасностей территорий и видов деятельности
14. Соотношение опасности и угрозы
15. Человеческий фактор в проблеме безопасности

Примерная тематика статей для рецензирования

Управление рыночными рисками и рисками потери ликвидности коммерческими банками в условиях кризиса
Система управления рисками: сравнительный анализ методов управления рисками организации
Концепция управления кредитными рисками в условиях нестабильности
Управление бюджетными рисками: развитие внутреннего финансового аудита
Особенности системы управления рисками мирового страхового рынка
Формирование проактивного управления рисками в период турбулентности внешней среды в контексте егп
Управление коррупционными рисками в таможенных органах как направление развития транзитного потенциала государства
Управление рисками в системе обеспечения продовольственной безопасности российской федерации
Проблематика управления рисками организаций при осуществлении внутреннего контроля и внутреннего аудита
Механизмы управления рисками в логистике
Анализ и управление рисками в российских и международных стандартах безопасности
Управление рисками проектов в органах власти
Роль страхования в системе управления финансовыми рисками предприятия
Управление рисками при esg-трансформации предприятий агропромышленного комплекса России
Страхование в системе управления рисками при строительстве жилых зданий
Мониторинг и оценка результатов управления операционными рисками
Роль системы управления рисками в формировании новых подходов к таможенному администрированию
Разработка регуляторных подходов к управлению рисками применения биомедицинских клеточных продуктов в российской федерации
Управление рисками в инвестиционно-строительном проекте в условиях неопределенности
Проблема управления рисками и обеспечение информационной безопасности в период пандемии

Пример статьи для рецензирования

УДК 0035.353.2

***Попов В.В.,
магистрант
кафедры социальных технологий и государственной службы
Института экономики и управления***

УПРАВЛЕНИЕ СОЦИАЛЬНЫМИ РИСКАМИ ЦИФРОВИЗАЦИИ ГОСУДАРСТВЕННОГО УПРАВЛЕНИЯ

Аннотация. В статье рассматривается процесс управления социальными рисками цифровизации государственного управления, определены социальные риски. Подчеркивается необходимость управления социальными рисками цифровизации государственного управления.

Ключевые слова: риск, социальные риски, управление рисками, риск-менеджмент, государственное управление, цифровизация государственного управления.

Annotation. The article examines the process of managing social risks of digitalization of public administration, defines social risks. The need to manage the social risks of digitalization of public administration is emphasized. The need to manage the social risks of digitalization of public administration is emphasized.

Key words: risk, social risks, risk management, public administration, digitalization of public administration.

После принятия государственной программы «Цифровая экономика РФ» началась активная деятельность по цифровизации всех сфер жизни общества. Развитие государственного управления с помощью внедрения цифровых технологий отражено в направлении «Цифровое государственное управление», которое направлено на предоставление гражданам и организациям доступа к приоритетным государственным услугам и сервисам в цифровом виде, создание национальной системы управления данными, развитие инфраструктуры электронного правительства, внедрение сквозных платформенных решений в государственное управление.

Основная цель использования цифровых технологий в деятельности органов власти - повышение эффективности государственного управления на основе создания общей информационно-технологической инфраструктуры, включающей государственные информационные системы и ресурсы, а также средства, обеспечивающие их функционирование, взаимодействие между собой или населением и организациями в рамках предоставления государственных услуг.

Под цифровизацией, мы понимаем, использование и внедрение новых цифровых технологий, основной целью которых будет являться повышение эффективности и результативности деятельности государственных органов [1]. Процесс внедрения инновационных решений напрямую связан с риском.

Стоит отметить, что не существует точного определения риска, которого бы все исследователи в этой области придерживались.

Одна из интерпретаций понятия «риск» представлено в трудах А.П. Альгина, который определял риск как деятельность, связанную с преодолением

неопределенности в ситуации неизбежного выбора, в процессе которой имеется возможность количественно и качественно оценить вероятность достижения предполагаемого результата, неудачи и отклонения от цели [2].

Боле универсальное определение риска описывается как двустороннее сочетание событий/последствий и связанных с ними неопределенностей[3].

Управление рисками – это определение событий, которые могут влиять на деятельность организации, и управление связанным с этими событиями риском, а также контроль отсутствия превышения предельно допустимого уровня риска организации и предоставление разумной гарантии достижения целей организации; поддержание уровня риска, обеспечивающего непрерывную деятельность и устойчивое развитие организации, получение оптимального результата деятельности организации с учетом риска для учредителей, собственников и иных заинтересованных сторон [4].

Под социальными рисками подразумеваются социальные последствия, определённые изменения от внедрения прорывных цифровых технологий в деятельность органов власти, наступления которых содержит вероятность потери либо ограничения самостоятельности и безопасности социальной системы.

К социальным рискам цифровизации государственного управления относятся:

- цифровое неравенство, как по территориальному признаку, так и по гендерно-возрастному, выражающееся в неравномерном доступе к информационно-коммуникационным технологиям;
- киберпреступность - несанкционированный доступ к данным населения, приводящий к нарушению их прав и свобод;
- зависимость от интернета – принудительный переход на цифровое управление, требующий от населения постоянного доступа в Интернет в любое время суток и в любом месте;
- «клиповое мышление» - восприятие мира через короткие яркие образы, негативно сказывающиеся на интеллектуальных способностях человека;
- отставание системы образования – постоянно изменяющиеся условия осуществления деятельности требуют наличия соответствующих компетенций, которые не могут быть определены заранее и соответственно включены в образовательный процесс, но имеющих ключевое значения для эффективного осуществления своей деятельности;
- физиологический, выражающийся в постоянной монотонной работе с гаджетами, информационно-коммуникационными технологиями, с незначительной физической активностью ведет к ухудшению здоровья, влекущей за собой уменьшение продолжительности жизни.

Мы выделяем 4 этапа управления социальными рисками:

1. Этап идентификации рисков, который заключается в поиске возможных рисков, которые могут оказать влияние на реализацию процесса цифровизации деятельности органов власти. Для определения рисков следует использовать количественные и качественные методы.

2. Этап анализа вероятности наступления рисков, который

характеризуется определением вероятности наступления риска с помощью ретроспективного анализа, экспертного подхода и проведения дополнительных исследований.

3. Этап реагирования на риски. Данный этап характеризуется разработкой мер по реагированию на возможные отклонения от определенных целей, акцентируя внимание на назначение за каждым риском ответственных, которые будут осуществлять деятельность по отслеживанию риска, а также реализации плана реагирования.

4. Этап мониторинга и контроля рисков, который направлен на обнаружение новых рисков, на подтверждение эффективности принимаемых мер по реагированию на возникающие риски, а также на наблюдение за рисками с помощью определения их катализаторов.

В процессе реализации программ и проектов в сфере цифровизации государственного управления управлению рисками уделено недостаточно внимания. Стоит отметить, что этап мониторинга и контроля рисков осуществляется по остаточному принципу, что может привести к серьезным отклонениям от цели во время реализации проектов и программ. Для предотвращения данных проблем необходимо разработать способы вовлечения пользователей благами от цифровизации государственного управления в процесс мониторинга и контроля рисков.

Можно сделать вывод, что цифровизация государственного управления напрямую связана с социальными рисками, так как все инновации направленные на повышение эффективности деятельности органов власти, в конечном счете, преследуют цель улучшения качества жизни населения. Для предотвращения наступления социальных рисков следует осуществлять риск-менеджмент и повышать его эффективность.

Использованные источники:

1. Об утверждении профессионального стандарта “Специалист по управлению рисками”: приказ Минтруда России от 07.09.2015 № 591н // Справочная правовая система «Консультант Плюс». Разд. «Законодательство». Информ. банк «Российское законодательство (Версия Проф)».

2. Альгин А.П. Риск и его роль в общественной жизни / А.П. Альгин. - М., – 1989. – 192 с.

3. Разуваев В.В. Теоретическое определение понятия риск / В.В. Разуваев // Современные научные исследования и инновации. – 2016. – № 9. – С 287-293.

4. Конюкова О.Л. Роль цифровизации в государственном управлении / О.Л. Конюкова, С.А. Летунов // Global and regional research. – 2019. – №1. – С. 74-79. «Научно-практический электронный журнал Аллея Науки» №6(57) 2021 Alley-science.ru

Пример рецензии на статью

Рецензия

на статью «_____», подготовленную
коллективом авторов в составе _____

1. Статья соответствует тематике (направлению) издательства *Полностью*
 2. Статья содержит: *Новые факты*
 3. Название статьи соответствует содержанию *Да*
 4. Аннотация (15–20 строк) *Четко отражает основное содержание статьи*
 5. Методы исследования *Адекватны целям статьи*
 6. Эксперименты и данные *Статистически обработаны*
 7. Обсуждение и интерпретация данных *Соответствует материалу*
 8. Рисунки и подписи к рисункам *Ясны и понятны*
 9. Таблицы и заголовки к таблицам *Хорошо соответствуют данным*
 10. Список литературы содержит ссылки на публикации за последние 5 лет.
Ссылки на иностранные источники использованы.
Достаточный
 11. Стиль статьи *Статья написана хорошим языком*
 12. Оригинальность текста (анализ текста и поиск копий в Интернете, eLibrary и др.): *Наличие заимствований не найдено*
 13. Заключение: *Следует рекомендовать для публикации*
 14. Дополнительные комментарии по рецензии _____
- Рецензент _____
Дата _____

5.4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

Основными формами текущего контроля являются тест, реферат, рецензия.

Соотношение вида работ и количества баллов в рамках процедуры оценивания

Вид работы	количество баллов
Рецензия	до 20 баллов
Тест	до 25 баллов
Реферат	до 25 баллов
Экзамен	до 30 баллов

Шкала оценивания теста

Освоение компетенций зависит от результата написания теста:

20-25 баллов (80-100% правильных ответов) - компетенции считаются освоенными на высоком уровне (оценка отлично);

15-19 баллов (70-75 % правильных ответов) - компетенции считаются освоенными на базовом уровне (оценка хорошо);

8-10 баллов (50-65 % правильных ответов) - компетенции считаются освоенными на удовлетворительном уровне (оценка удовлетворительно);

0-7 баллов (менее 50 % правильных ответов) - компетенции считаются не освоенными (оценка неудовлетворительно).

Шкала оценивания реферата

Критерии оценивания	Интервал оценивания
1. Степень раскрытия темы	0-6
2. Личный вклад автора	0-3
3. Структурированность материала	0-2
4. Постраничные ссылки	0-2
5. Объем и качество используемых источников	0-4
6. Оформление текста и грамотность речи	0-2
7. Защита работы	0-6
Общая сумма баллов:	25

Шкала оценивания рецензии

Критерии оценивания	Интервал оценивания
1. владение профессиональной терминологией	0-4
2. умение высказывать и обосновать свои суждения	0-4
3. структурированность материала	0-6
4. оформление текста и грамотность речи	0-6
Общая сумма баллов:	20

Шкала оценивания экзамена

Критерии оценивания	Интервал оценивания
студент быстро и самостоятельно готовится к ответу; при ответе полностью раскрывает сущность поставленного вопроса; способен проиллюстрировать свой ответ конкретными примерами; демонстрирует понимание проблемы и высокий уровень ориентировки в ней; формулирует свой ответ самостоятельно, используя лист с письменным вариантом ответа лишь как опору, структурирующую ход рассуждения	21-30
студент самостоятельно готовится к ответу; при ответе раскрывает основную сущность поставленного вопроса; демонстрирует понимание проблемы и достаточный уровень ориентировки в ней, при этом затрудняется в приведении конкретных примеров.	13-20
студент готовится к ответу, прибегая к некоторой помощи; при ответе не в полном объеме раскрывает сущность поставленного вопроса, однако, при этом, демонстрирует понимание проблемы.	6-12
студент испытывает выраженные затруднения при подготовке к ответу, пытается воспользоваться недопустимыми видами помощи; при ответе не раскрывает сущность поставленного вопроса; не ориентируется в рассматриваемой проблеме; оказываемая стимулирующая помощь и задаваемые уточняющие вопросы не способствуют более продуктивному ответу студента.	0-5

Итоговая шкала оценивания результатов освоения дисциплины

Итоговая оценка по дисциплине выставляется по приведенной ниже шкале. При выставлении итоговой оценки преподавателем учитывается работа обучающегося в течение освоения дисциплины, а также оценка по промежуточной аттестации.

Баллы, полученные студентом по текущему контролю и промежуточной аттестации	Оценка в традиционной системе
81 – 100	отлично
61 - 80	хорошо
41 - 60	удовлетворительно
0 - 40	неудовлетворительно