

МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное  
образовательное учреждение высшего образования  
«Тульский государственный университет»

Институт прикладной математики и компьютерных наук  
Кафедра «Прикладная математика и информатика»

Утверждено на заседании кафедры  
«Прикладная математика и информатика»  
24 января 2023 г., протокол № 5

И.о. заведующего кафедрой

 Н.В. Ларин

**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ (ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ) ДЛЯ  
ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ И  
ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО  
ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)**

**«Теория риска и моделирование рискованных ситуаций»**

**основной профессиональной образовательной программы  
высшего образования – программы магистратуры**

по направлению подготовки  
**01.04.02 Прикладная математика и информатика**

с направленностью (профилем)  
**Перспективные методы искусственного интеллекта  
в сетях передачи и обработки данных**

Форма обучения: очная

Идентификационный номер образовательной программы: 010402-03-23

Тула 2023 год

**ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЯ**  
**фонда оценочных средств (оценочных материалов)**

**Разработчик:**

Ларин Н.В., доцент каф. ПМиИ, д.ф.-м.н.

---

(ФИО, должность, ученая степень, ученое звание)



---

(подпись)

## **1 Описание фонда оценочных средств (оценочных материалов)**

Фонд оценочных средств (оценочные материалы) включает в себя контрольные задания и (или) вопросы, которые могут быть предложены обучающемуся в рамках текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине (модулю). Указанные контрольные задания и (или) вопросы позволяют оценить достижение обучающимся планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), установленных в соответствующей рабочей программе дисциплины (модуля), а также сформированность компетенций, установленных в соответствующей общей характеристике основной профессиональной образовательной программы.

Полные наименования компетенций и индикаторов их достижения представлены в общей характеристике основной профессиональной образовательной программы.

## **2 Оценочные средства (оценочные материалы) для проведения текущего контроля успеваемости обучающихся по дисциплине (модулю)**

### **Перечень контрольных заданий и (или) вопросов для оценки сформированности компетенции ПК-1 (контролируемый индикатор достижения компетенции ПК-1.1)**

1. Хозяйственный риск: понятие и классификация.
2. Неопределенность: понятие и виды.
3. Неопределенность и хозяйственный риск.
4. Общая характеристика хозяйственных рисков.
5. Функции хозяйственного риска.
6. Объекты, субъекты и характерные черты хозяйственного риска.
7. Риск как источник прибыли.
8. Риск и доходность.
9. Факторы риска.
10. Система рисков в хозяйственной деятельности.

### **Перечень контрольных заданий и (или) вопросов для оценки сформированности компетенции ПК-1 (контролируемый индикатор достижения компетенции ПК-1.2)**

1. Классификация хозяйственных рисков.
2. Производственные риски, их классификация и характеристика.
3. Финансовые риски, их классификация и характеристика.
4. Коммерческие риски, их классификация и характеристика.
5. Инвестиционные риски, их классификация и характеристика.
6. Валютные риски, их классификация и характеристика.
7. Кредитные риски, их классификация и характеристика.
8. Банковские риски, их классификация и характеристика.
9. Классификация транспортных рисков.
10. Факторы внешней среды в управлении хозяйственным риском.

### **Перечень контрольных заданий и (или) вопросов для оценки сформированности компетенции ПК-1 (контролируемый индикатор достижения компетенции ПК-1.3)**

1. Факторы внутренней среды в рискованной деятельности организации.
2. Среда прямого воздействия на организацию.
3. Среда косвенного воздействия на организацию.
4. Идентификация и анализ хозяйственного риска.

5. Методы выявления хозяйственных рисков: сущность и характеристика.
6. Качественный анализ хозяйственных рисков.
7. Количественный анализ хозяйственных рисков.
8. Зоны хозяйственного риска.
9. Построение кривой риска организации.
10. Пороговые значения риска.

### **3 Оценочные средства (оценочные материалы) для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю)**

#### **Перечень контрольных заданий и (или) вопросов для оценки сформированности компетенции ПК-1 (контролируемый индикатор достижения компетенции ПК-1.1)**

1. Показатели степени риска.
2. Экономико-статистические методы оценки риска.
3. Метод экспертных оценок анализа хозяйственного риска.
4. Основные понятия и показатели оценки эффективности инвестиций.
5. Анализ степени риска реализации инвестиционных проектов.
6. Методы анализа риска инвестиционных проектов.
7. Риск инвестирования в отдельный актив.
8. Риск инвестиционного портфеля.
9. Модель увязки систематического риска и доходности ценных бумаг CAPM (Capital Asset Pricing Model).
10. Методы анализа риска инвестиционного портфеля.

#### **Перечень контрольных заданий и (или) вопросов для оценки сформированности компетенции ПК-1 (контролируемый индикатор достижения компетенции ПК-1.2)**

1. Анализ корреляционной зависимости финансовых активов в портфеле ценных бумаг.
2. Сущность и содержание риск-менеджмента.
3. Понятие, цель и задачи риск-менеджмента.
4. Управление хозяйственным риском.
5. Этапы управления хозяйственным риском.
6. Методы управления рисками.
7. Основные правила менеджмента риска.
8. Методы уклонения от риска.
9. Методы компенсации риска.
10. Методы финансирования рисков (покрытия убытков).

#### **Перечень контрольных заданий и (или) вопросов для оценки сформированности компетенции ПК-1 (контролируемый индикатор достижения компетенции ПК-1.3)**

1. Принятие решения о выборе метода управления риском.
2. Покрытие убытков на основе страхования.
3. Содержание и виды страхования.
4. Основные понятия в страховом деле.
5. Способы определения суммы страхового возмещения.
6. Понятие франшизы, ее виды, порядок применения.
7. Имущественное страхование.
8. Основные показатели в страховании.
9. Определение экономического ущерба вследствие простоев производства.
10. Страхование финансовых рисков.