

КОЛИЧЕСТВЕННЫЕ МЕТОДЫ В ФИНАНСОВОМ МЕНЕДЖМЕНТЕ

Учебный модуль по направлению подготовки
38.04.02 Менеджмент профиль «Финансовый менеджмент»

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Принято на заседании
Ученого совета ИЭУ
17.05 2017 г.
Протокол № 5
Зам. директора института
Т.В. Кудряшова
подпись

Разработал:
доцент КПЭЖ
Т.В. Кудряшова
подпись
12 мая 2017 г.
число месяц

Принято на заседании кафедры
Протокол № 10 от 15.05 2017 г.

Заведующий кафедрой КПЭЖ
Т.В. Кудряшова
подпись

**Паспорт фонда оценочных средств по учебному модулю
«Количественные методы в финансовом менеджменте»**

Модуль, раздел (в соответствии с РП)	Контролируемые компетенции (или их части)	ФОС	
		Вид оценочного средства	Количество вариантов заданий
Тема 1 Предмет, метод и задачи курса «Количественные методы в финансовом менеджменте»	ОПК-3, ПК-3	Дискуссия	Дискуссия – 16; Разноуровневые задачи – 20; Лабораторные работы – 3; Реферат – 36
Раздел 1 Детерминированные методы		Дискуссия, разноуровневые задачи	
Тема 2 Графы и сети как детерминированные методы управления		Дискуссия, разноуровневые задачи	
Тема 3 Линейное программирование (планирование)		Дискуссия	
Тема 4 Экономический анализ для принятия управленческих решений		Дискуссия, разноуровневые задачи	
Тема 5 Детерминированный факторный анализ в финансовом менеджменте		Дискуссия, разноуровневые задачи	
Тема 6 Балансовое уравнение		Дискуссия, разноуровневые задачи	
Тема 7 Управление запасами		Дискуссия, разноуровневые задачи	
Тема 8 Методы прогнозирования		Дискуссия, защита лабораторных работ	
Раздел 2 Стохастические методы		Дискуссия	
Тема 9 Случайные события и вероятности		Дискуссия, защита лабораторных работ	
Тема 10. Корреляция и регрессия			
Тема 11 Проверка статистических гипотез		Дискуссия	
Тема 12 Использование инструментария многомерного статистического анализа (МСА) в управлении		Дискуссия	
Тема 13 Метод главных компонент в финансовом менеджменте		Дискуссия, разноуровневые задачи	
Тема 14 Дисперсионный анализ в финансовом менеджменте		Дискуссия, разноуровневые задачи	
Тема 15 Кластерный анализ данных	Дискуссия, защита лабораторных работ, реферат		
Тема 16 Дискриминантный анализ данных	Дискуссия, разноуровневые задачи		
Семестровая аттестация по УМ «Количественные методы в финансовом менеджменте»	Экзамен	Комплект из 13 билетов	

Основные характеристики и параметры оценивания

Характеристика оценочного средства «Дискуссия»

Общие сведения об оценочном средстве

Дискуссия является одним из средств текущего контроля в освоении учебного модуля. Дискуссия проводится во время аудиторной работы студентов и призвана

закрепить и расширить знания, полученные студентами при изучении теоретического материала. Перед проведением дискуссии необходимо предоставить время студентам для самостоятельной подготовки к заявленной тематике. Студенты могут использовать презентационные материалы для наглядного подтверждения своей позиции.

Максимальное количество баллов, которые студент может набрать в результате проведения дискуссии по теме равно 5 баллам.

Параметры оценки дискуссии для модуля «Количественные методы в финансовом менеджменте»

Условия оценки работы	
Предел длительности контроля знаний	10-15 мин
Предлагаемое количество вопросов	16 вариантов тем
Последовательность выборки варианта	Согласно тематике
Критерии оценки:	
4-5 баллов	Активно участвовал в дискуссии Применил навыки использования знаний количественных методов Высказал собственную позицию
3 балла	Участвовал в дискуссии Частично применил навыки использования знаний количественных методов
0 баллов	Не участвовал в дискуссии

Оценочное средство «Разноуровневые задачи»

Общие сведения об оценочном средстве

Решение разноуровневых задач является одним из средств систематизации полученных теоретических знаний и контроля в освоении учебного модуля. Во время решения задач оценивается способность студента правильно решить задачу с привлечением необходимых теоретических знаний, умение объяснить выбранный ход решения, ориентироваться в терминологии и применять полученные в ходе лекций и практических занятий знания.

Разноуровневые задачи отличаются как по сложности, так и по количеству в зависимости от темы курса. Поэтому оценка решения разноуровневых задач осуществляется на каждом практическом занятии из расчета максимум 10 баллов за все задачи, относящиеся к конкретному практическому занятию.

Параметры оценки разноуровневых задач для модуля «Количественные методы в финансовом менеджменте»

Условия оценки работы	
Предел длительности контроля знаний	40-90 мин.
Предлагаемое количество разноуровневых задач	20
Последовательность выборки задач	Согласно установленному номеру задачи в рамках конкретной темы
Критерии оценки:	
9-10 баллов	Разноуровневые задачи, предусмотренные к решению на практическом занятии и в рамках самостоятельной

	работы, выполнены правильно, сделаны корректные выводы, даны глубокие комментарии
7-8 баллов	Разноуровневые задачи, предусмотренные к решению на практическом занятии и в рамках самостоятельной работы, выполнены правильно, сделаны корректные выводы
5-6 баллов	Разноуровневые задачи, предусмотренные к решению на практическом занятии и в рамках самостоятельной работы, частично выполнены правильно, в выводах есть неточности, отсутствуют комментарии
0 баллов	Разноуровневые задачи, предусмотренные к решению на практическом занятии и в рамках самостоятельной работы, не выполнены

Оценочное средство «Защита лабораторных работ»

Общие сведения об оценочном средстве

Программа модуля «Количественные методы в финансовом менеджменте» предусматривает обязательное выполнение и защиту трех лабораторных работ. Порядок и требования к выполнению лабораторных работ представлены в учебно-методическом пособии «Методические указания по выполнению лабораторных работ по курсу «Количественные методы в финансовом менеджменте» для студентов очного и заочного обучения / авт.-сост. Т.В. Кудряшова. – В. Новгород, 2017».

Лабораторные работы №1 «Анализ временных рядов и прогнозирование в Excel» (ЛР1), №2 «Прогнозирование временных рядов в модуле ARIMA» (ЛР2), №3 «Кластерный анализ в Statistica» (ЛР3).

Задания по лабораторным работам носят индивидуализированный характер, т.е. каждый студент работает по своим данным, зарегистрированным у преподавателя, отражающим специфику его научного исследования. По каждой лабораторной работе каждый студент предоставляет твердую копию отчета, оформленного в соответствии с требованиями оформления текстовых документов.

Максимальное количество баллов, которые может получить студент, защищая лабораторные работы:

ЛР1 – 20 баллов,

ЛР2 – 20 баллов,

ЛР3 – 20 баллов,

По каждой лабораторной работе студенту задаются 12 вопросов, из которых он должен правильно ответить на 8, чтобы защита состоялась. Защита лабораторных работ может проходить как в устной, так и в письменной форме.

Примерные вопросы для защиты лабораторных работ представлены в приложении А рабочей программы УМ.

Параметры оценочного средства «Защита лабораторных работ» для модуля «Количественные методы в финансовом менеджменте»

Условия проведения защиты лабораторных работ	
Предел длительности контроля	20 мин
Предлагаемое количество вопросов по каждой лабораторной работе	12
Последовательность выборки вопросов	случайная

Критерии оценки:	
«18-20 баллов»	Лабораторная работа выполнена на высоком профессиональном уровне, все задания выполнены верно. Отчет оформлен в соответствии с требованиями. На все вопросы даны правильные полные ответы. Для получения 8 правильных ответов было достаточно задать 8-9 вопросов
«14-17 баллов»	Лабораторная работа выполнена на достаточном уровне. В основном задания выполнены правильно и в необходимом объеме. Отчет оформлен в соответствии с требованиями. На все вопросы даны правильные полные ответы. Для получения 8 правильных ответов было достаточно задать 9-10 вопросов
«10-13 баллов»	Лабораторная работа выполнена в полном объеме, но имеются незначительные ошибки. Отчет оформлен при соблюдении не всех требований к оформлению текстовых документов. На все вопросы даны правильные полные ответы. Для получения 8 правильных ответов было достаточно задано 11-12 вопросов
Работа не зачитывается, студент приглашается на повторную защиту	Лабораторная работа выполнена не в полном объеме и (или) с существенными ошибками. Отчет оформлен без соблюдения требований к оформлению текстовых документов. На более чем 5 заданных вопросов даны неверные ответы или ответов не последовало.

Оценочное средство «Контрольная работа (реферат)»

Общие сведения об оценочном средстве

Подготовка студентом контрольной работы (реферата) является одним из видов текущего контроля и оценки его знаний, умений и навыков, уровня сформированности компетенций при освоении учебного модуля «Количественные методы в финансовом менеджменте». Для студентов очной формы обучения реферат выступает творческим заданием и выполняется по желанию студента, для студентов заочной формы обучения – обязательным элементом текущего контроля.

Реферат является частью самостоятельной работы студента, но также используется как оценочное средство. В реферате студент излагает в письменной форме результаты теоретического анализа заранее полученной или выбранной им самим темы, а также собственный взгляд на исследуемый вопрос. Максимальное количество баллов за реферат определяется целями УМ и составляет 20 баллов.

Для написания реферативной работы студенту рекомендуется выбрать одну из предложенных тем или предложить свою тему. Объем реферата, как правило, составляет 15-20 страниц. При написании должно быть использовано не менее трех источников. Сноски на научную литературу обязательны. Структура реферативной работы: введение; содержание; основная часть, которая, в свою очередь, может состоять из нескольких разделов; заключение, список использованных источников. Реферат оформляется в соответствии с правилами оформления текстовых документов, разработанных на основе соответствующих стандартов, в институте экономики и управления НовГУ.

Параметры оценочного средства «Контрольная работа (реферат)» для модуля «Количественные методы в финансовом менеджменте»

Условия оценки выполнения курсовой работы	
Предел длительности	16 недель

контроля знаний	
Предлагаемое количество вариантов тем контрольной работы (реферата)	36 У каждого студента свой вариант контрольной работы (реферата)
Последовательность выборки варианта тем контрольной работы (реферата)	Выбор варианта темы контрольной работы (реферата) осуществляется в соответствии с темой научно-исследовательской работы магистранта и темой ВКР
Критерии оценки:	
18 – 20 баллов	Контрольная работа (реферат) выполнена на высоком научном уровне, имеет элементы новизны. Студент демонстрирует не только знание предмета исследования, но и аргументировано высказывает свою позицию по рассматриваемым вопросам. Работа оформлена по всем правилам, предъявляемым к текстовым документам
14 – 17 баллов	Контрольная работа (реферат) выполнена на достаточно высоком уровне, имеет элементы новизны. Студент демонстрирует не только знание предмета исследования, но и высказывает свою позицию по рассматриваемым вопросам. Работа в целом оформлена по всем правилам, предъявляемым к текстовым документам
10 – 13 баллов	Контрольная работа (реферат) раскрывает заявленную тему. Студент демонстрирует удовлетворительное знание предмета исследования, не высказывая свою позицию по рассматриваемым вопросам. Работа в целом оформлена по правилам, предъявляемым к текстовым документам

Характеристика оценочного средства «Экзамен»

Общие сведения об оценочном средстве

Экзамен по билету является формой семестрового контроля знаний, умений и готовностей студента. Допуском для сдачи экзамена выступает защита всех лабораторных работ и защита контрольной работы (для студентов заочной формы обучения). Подготовка к экзамену выполняется внеаудиторно, разрешается использовать любые материалы. Во время сдачи самого экзамена (аудиторно) не разрешается использовать какие-либо материалы.

Экзаменационные вопросы включают материал, охватывающий все разделы УМ. В процессе экзамена подвергается проверке: усвоение теоретического материала УМ, умение правильно оперировать понятиями и терминами, уровень знания конкретного материала, а также наличие навыков использования инструментария количественных методов при решении практических задач.

При проведении испытания экзаменационный билет выбирает обучающийся методом случайного отбора. Время подготовки устного ответа должно составлять не более 60 минут. В процессе сдачи экзамена обучающемуся могут быть заданы дополнительные вопросы, как по содержанию экзаменационного билета, так и по любым разделам учебного модуля. Максимальное количество баллов за экзамен – 50 баллов. Оценка по устному экзамену объявляется сразу после завершения опроса.

Параметры оценочного средства «Экзамен» для модуля «Количественные методы в финансовом менеджменте»

Условия проведения экзамена	
Предел длительности контроля знаний	45-75 минут

Предлагаемое количество билетов	13
Последовательность выборки тем	случайная
Критерии оценки:	
«5» – 45-50 баллов, если	<p>Полно раскрыто содержание материала билета. Материал изложен грамотно, в определенной логической последовательности, точно используется терминология. Показано умение иллюстрировать теоретические положения конкретными примерами, применять их в новой ситуации. Ответ прозвучал самостоятельно, без наводящих вопросов. Допущены одна-две неточности при освещении второстепенных вопросов, которые исправляются по замечанию. Правильно и с необходимыми пояснениями решена задача.</p>
«4» – 35-44 баллов, если	<p>В изложении допущены небольшие пробелы, не исказившие содержание ответа. Допущены один-два недочета при освещении основного содержания ответа, исправленные по замечанию экзаменатора. Допущены ошибка или более двух недочетов при освещении второстепенных вопросов, которые легко исправляются по замечанию экзаменатора. В целом правильно решена предложенная задача, но допущены отдельные недочеты.</p>
«3» – 25-34 баллов, если	<p>Неполно или непоследовательно раскрыто содержание материала, но показано общее понимание вопроса и продемонстрированы умения, достаточные для дальнейшего усвоения материала. Имелись затруднения или допущены ошибки в определении понятий, использовании терминологии, исправленные после нескольких наводящих вопросов. При решении задачи допущены арифметические ошибки, задача решена частично (показан ход решения, приведены необходимые экономико-математические формулы).</p>