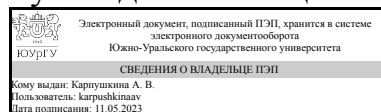


УТВЕРЖДАЮ:  
Руководитель специальности



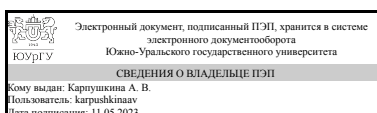
А. В. Карпушкина

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

дисциплины 1.Ф.15 Риски управления финансовыми активами  
для специальности 38.05.01 Экономическая безопасность  
уровень Специалитет  
форма обучения заочная  
кафедра-разработчик Экономическая безопасность

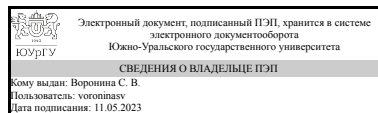
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность, утверждённым приказом Минобрнауки от 14.04.2021 № 293

Зав.кафедрой разработчика,  
Д.Экон.н., доц.



А. В. Карпушкина

Разработчик программы,  
к.Экон.н., доцент



С. В. Воронина

## 1. Цели и задачи дисциплины

Цель: формирование теоретических знаний и практических навыков в области управления рисками финансовых активов. Задачи: – рассмотреть основные инвестиционные характеристики различных видов финансовых активов; – овладеть профессиональной терминологией в сфере портфельных инвестиций и рисков управления финансовыми активами; – сформировать представление о портфельном инвестировании; – рассмотреть основные модели оценки портфелей финансовых активов; – изучить показатели эффективности управления финансовыми активами; – ознакомиться с методами выявления и идентификации рисков при управлении финансовыми активами с учетом сведений об операциях (сделках), подлежащих обязательному контролю в сфере ПОД/ФТ.

## Краткое содержание дисциплины

В курсе рассматриваются теоретические аспекты управления рисками финансовых активов и методы оценки их стоимости и доходности. Особое внимание уделяется формированию портфелей финансовых активов с позиции достижения оптимального соотношения между риском и доходностью портфеля. способам определения оптимальных портфелей и эффективной границы, а также моделям оценки доходности финансовых активов. Рассматриваются вопросы связанные со стратегиями управления портфелем финансовых активов и оценкой их рисков. Проводится анализ рыночных и специфических рисков, в том числе при принятии решений об инвестировании в финансовые активы с учетом обязательного контроля в сфере ПОД/ФТ. Значительная часть курса посвящена вопросам оценки эффективности управления портфелем финансовых активов.

## 2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-4 Способен подготавливать исходные данные, необходимые для расчета экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов, нормативного обеспечения и внедрения системы управления рисками, а также разрабатывать предложения по вопросам повышения эффективности управления рисками в соответствии со стратегическими целями организации.	Знает: – понятийно-терминологический аппарат, характеризующий финансовые риски в деятельности хозяйствующих субъектов; – методы исследования рисков финансовых активов; – модели оценки портфелей финансовых активов. Умеет: – проводить исследования рисков финансовых активов; – разрабатывать стратегии управления рисками финансовых активов; – оценивать риски управления портфелями финансовых активов. Имеет практический опыт: – владения методами анализа доходности, риска и эффективности инвестиционных вложений в финансовые активы; – принятия решения по формированию портфеля финансовых активов и выработки рекомендаций по снижению риска портфеля.
ПК-8 Способен определять порядок и организовывать работу с нормативными документами, в т.ч. сведениями об операциях	Знает: – нормативные документы в сфере ПОД/ФТ при формировании портфеля финансовых активов хозяйствующих субъектов;

<p>(сделках), подлежащих обязательному контролю в сфере ПОД/ФТ, устанавливать виды и формы ответственности работников организации, принимать решения по устранению выявленных нарушений.</p>	<p>– принципы и методы выбора источников финансирования с учетом обязательного контроля в сфере ПОД/ФТ; – методы выявления и идентификации рисков при управлении финансовыми активами с учетом сведений об операциях (сделках), подлежащих обязательному контролю в сфере ПОД/ФТ.          Умеет: – проводить анализ рыночных и специфических рисков, в том числе при принятии решений об инвестировании в финансовые активы с учетом обязательного контроля в сфере ПОД/ФТ; - осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для принятия решений по операциям (сделкам), подлежащим контролю в сфере ПОД/ФТ; – оценивать предлагаемые варианты управленческих решений по снижению рисков при осуществлении операций (сделок) с финансовыми активами, подлежащих обязательному контролю в сфере ПОД/ФТ.          Имеет практический опыт: – обработки данных, необходимых для решения профессиональных задач в области управления рисками финансовых активов с учетом обязательного контроля в сфере ПОД/ФТ; – владения методами снижения степени финансовых рисков при управлении финансовыми активами, в т.ч. при операциях (сделках), подлежащих обязательному контролю в сфере ПОД/ФТ.</p>
--	--

### 3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
<p>1.Ф.14 Комплексный анализ хозяйственной деятельности,            1.Ф.06 Оценка рисков в экономической безопасности,            1.Ф.04 Теневая экономика,            1.Ф.07 Практикум по виду профессиональной деятельности,            1.О.26 Контроль и ревизия,            1.Ф.10 Комплаенс-контроль,            1.Ф.11 Кадровое обеспечение экономической безопасности,            1.Ф.08 Инвестиционная политика предприятия,            1.Ф.02 Организация конфиденциального документооборота,            Производственная практика (научно-исследовательская работа) (8 семестр)</p>	<p>1.Ф.17 Стратегические аспекты экономической безопасности</p>

Требования к «входным» знаниям, умениям, навыкам студента, необходимым при освоении данной дисциплины и приобретенным в результате освоения предшествующих дисциплин:

Дисциплина	Требования
1.Ф.11 Кадровое обеспечение экономической безопасности	<p>Знает: - нормативную базу в сфере ПОД/ФТ; - методические и организационно-управленческие подходы к организации системы ПОД/ФТ хозяйствующих субъектов. Умеет: - разрабатывать правила деятельности персонала в целях ПОД/ФТ на предприятии; - организовывать работу по реализации правил деятельности персонала в целях ПОД/ФТ на предприятии. Имеет практический опыт: - организации работы с персоналом по выявлению операций (сделок), подлежащих контролю в целях ПОД/ФТ, на предприятии; - контроля реализации персоналом предприятия правил деятельности в целях ПОД/ФТ.</p>
1.Ф.14 Комплексный анализ хозяйственной деятельности	<p>Знает: - основы организации и функционирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов; - содержание основных бизнес-процессов хозяйствующего субъекта и его подразделений, их взаимосвязи и особенностей функционирования;- методики составления прогноза основных финансово-хозяйственных показателей деятельности организации., - основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов;- методики подготовки исходных данных, необходимых для расчета экономических показателей. Умеет: - рассчитывать на основе существующих типовых методик и действующей нормативно-правовой базы экономические показатели деятельности хозяйствующих субъектов; - применять аналитические методы и методики анализа финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов для выявления возможных отклонений от поставленных целей; - получать, анализировать и использовать информацию, содержащуюся в официальной бухгалтерской и финансовой отчетности хозяйствующих субъектов;- выявлять проблемы экономического характера при анализе конкретных ситуаций, предлагать способы их решения с учетом критериев социально-экономической эффективности, оценки рисков и экономической безопасности бизнеса. Имеет практический опыт: - составления прогнозов финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов., - сбора, обработки и изучения данных, составляющих базы информационного обеспечения комплексного анализа деятельности хозяйствующих субъектов;- оценки показателей деятельности хозяйствующих субъектов и их бизнес-единиц.</p>
1.Ф.07 Практикум по виду профессиональной деятельности	<p>Знает: - основные методы сбора, обработки, накопления и анализа управленческой</p>

	<p>информации, используемой для принятия решений по предупреждению и нейтрализации угроз экономической безопасности предприятия;</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- содержание и методику расчета экономических показателей, характеризующих деятельность конкретного хозяйствующего субъекта. Умеет: - проводить расчет и анализ основных показателей финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов, нацеленных на выявление рисков и угроз экономической безопасности этих хозяйствующих субъектов; - на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие экономическую безопасность хозяйствующих субъектов; - анализировать и интерпретировать информацию, содержащуюся в учетно-отчетной документации, использовать полученные сведения для принятия решений по предупреждению, локализации и нейтрализации угроз экономической безопасности с использованием программных средств и технологий (информационно-аналитический вид деятельности), - анализировать и интерпретировать содержащуюся в учетно-отчетной документации информацию, использовать полученные сведения для принятия решений по предупреждению и нейтрализации угроз экономической безопасности предприятия. Имеет практический опыт: - осуществления отчетной работы по результатам расчета и анализа основных показателей финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов с целью выявления и контроля рисков и угроз экономической безопасности компании, а также повышения экономической эффективности ведения бизнеса - анализа рисков экономической безопасности и их последствий, составления и обоснования прогнозов основных угроз экономической безопасности с использованием программных инструментов - сбора и подготовки информационно-аналитических данных для расчета показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.</li> </ul>
<p>1.О.26 Контроль и ревизия</p>	<p>Знает: - способы, приемы и порядок работы с нормативными документами при анализе результатов контроля финансово-хозяйственной деятельности., - методы и приемы контроля, методы и приемы экономического анализа в целях оценки эффективности и прогнозирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта. Умеет: - идентифицировать микро-, мезо- и макроуровень административного и финансового контроля и характеризовать соответствующие каждому</p>

	<p>уровню виды рисков с целью их ограничения/нейтрализации., - использовать финансовые и нефинансовые источники информации для выявления отклонений и нарушений, касающихся деятельности предприятия и функционирования его активов. Имеет практический опыт: - разработки мер, направленных на ограничение рисков финансово-хозяйственной деятельности при проведении предварительного, текущего и последующего контроля и оценки на их основе эффективности системы внутреннего контроля организации.</p>
1.Ф.08 Инвестиционная политика предприятия	<p>Знает: – методы и модели оценки рисков инвестиционного проекта; – различные виды эффективности инвестиционных проектов;– методы оценки эффективности инвестиционных проектов для определения целесообразности реализации разработанных проектных решений. Умеет: – разрабатывать различные варианты управленческих решений по вопросам инвестиционной политики компании и обосновывать их целесообразность., – формировать денежные потоки инвестиционного проекта для дальнейшей оценки его эффективности;– принимать решения, связанные с инвестиционной политикой предприятия, в условиях рыночной неопределенности и риска, и оценивать их эффективность. Имеет практический опыт: – оценки рисков предложенных инвестиционных решений; – оценки эффективности инвестиционного проекта; – осуществления выбора оптимального инвестиционного проекта по критерию минимизации рисков.</p>
1.Ф.04 Теневая экономика	<p>Знает: - правовые и организационно-экономические средства предупреждения и пресечения теневизации экономической деятельности;- сущность теневой экономики, методы выявления и оценки ее параметров; - социально-экономические последствия теневой экономической деятельности., - сущность и содержание коррупционных проявлений как социально-правового явления; - основные направления профилактики коррупционного поведения и пресечения теневой экономической деятельности. Умеет: ; - исследовать специфику проявления теневой деятельности в различных общественно-экономических системах и в мировом пространстве; - выявлять и устранять причины и условия, способствующие теневизации экономики; - разрабатывать и проводить мероприятия по противодействию теневизации экономики, легализации криминальных доходов. Имеет практический опыт: - профилактики, предупреждения</p>

	<p>преступлений и иных правонарушений в сфере экономики в т.ч. в сфере ПОД/ФТ, определения видов и форм ответственности за ведение теневой деятельности; - выявления и устранения причин и условий, способствующих коррупционным проявлениям в экономической системе.</p>
<p>1.Ф.02 Организация конфиденциального документооборота</p>	<p>Знает: - нормативно-правовые документы в области защиты государственной и коммерческой тайны, обеспечения режима секретности; - основные характеристики и состав документации в области защиты государственной и коммерческой тайны хозяйствующих субъектов. Умеет: - оценивать риски и угрозы экономической безопасности, возникающие в случаях нарушения защиты государственной и коммерческой тайны, обеспечения режима секретности; - составлять и систематизировать номенклатуру дел в целях обеспечения экономической безопасности организации, в том числе в области защиты государственной и коммерческой тайны хозяйствующих субъектов. Имеет практический опыт: - работы по выявлению и контролю информации, составляющей государственную и коммерческую тайну,- предупреждения и пресечения преступлений и иных правонарушений в области защиты государственной и коммерческой тайны, обеспечения режима секретности.</p>
<p>1.Ф.10 Комплаенс-контроль</p>	<p>Знает: - нормативную базу в сфере ПОД/ФТ; - принципы обеспечения соответствия деятельности организаций законодательству, внутренним документам, стандартам, обычаям делового оборота., - методические подходы к оценке и управлению комплаенс-рисками. Умеет: - разрабатывать правила комплаенс- контроля в целях ПОД/ФТ в организации; - анализировать риски бизнес-процессов с позиции комплаенс-контроля; - разрабатывать и использовать в работе систему комплаенс-контроля рисков организации; - осуществлять расчеты, прогнозировать и верифицировать методики управления комплаенс-рисками с учетом отраслевой специфики. Имеет практический опыт: - организации работы по выявлению операций (сделок), подлежащих контролю в целях ПОД/ФТ, в организации; - контроля реализации работниками организации правил комплаенс-контроля в целях ПОД/ФТ.</p>
<p>1.Ф.06 Оценка рисков в экономической безопасности</p>	<p>Знает: - основные стратегические подходы к управлению рисками организации;- основные инструменты управления рисками хозяйствующих субъектов., - сущность риска как экономической и управленческой категории в т.ч. с точки зрения международных и отечественных</p>

	<p>стандартов;- классификацию рисков и угроз экономической безопасности организации по различным критериям;- методы оценки вероятности наступления риска и ожидаемого ущерба в деятельности хозяйствующих субъектов;- методические подходы к сравнению риска по совокупной оценке влияния на уровень экономической безопасности хозяйствующего субъекта., - методы расчета финансово-экономических показателей при выявлении, оценке и прогнозировании рисков деятельности организации. Умеет: - применять инструментарий снижения и оптимизации рисков организации., - идентифицировать риски деятельности хозяйствующих субъектов;- оценивать вероятность наступления и ожидаемый ущерб от реализации рисков деятельности хозяйствующих субъектов;- проводить сравнительный анализ рисков деятельности хозяйствующих субъектов., - прогнозировать показатели рисков и обосновывать уровень достоверности построенного прогноза Имеет практический опыт: - разработки управленческих решений в отношении управления рисками на основе ранее проведенной оценки риска., - построения реестра рисков для идентификации рисков и систематизации результатов оценки и обработки рисков;- оценки вероятности наступления риска и ожидаемого ущерба экономической безопасности, построения карты рисков (матрицы рисков) по критериям вероятности реализации и потенциальной угрозы., - оценки вероятности попадания экономических показателей деятельности организации в рискованный и угрожающий диапазон</p>
<p>Производственная практика (научно-исследовательская работа) (8 семестр)</p>	<p>Знает:- технологии обработки собранной информации для принятия решений по исследуемой сфере профессиональной деятельности;- области теоретического и практического применения имеющихся исследований; - основные показатели, характеризующие деятельность экономических субъектов на макро, мезо – и микроуровнях; - источники получения необходимой информации для проведения анализа. Умеет: - применять эффективные процедуры анализа в целях систематизации и интерпретации полученной информации о происходящих социально-экономических процессах и явлениях в области экономической безопасности; - выбирать и адаптировать методы анализа теоретического материала и практических данных в области экономической безопасности;- ориентироваться в результатах новейших отечественных и зарубежных теоретических и прикладных</p>



	<p>исследований в выбранной области;- выбирать и систематизировать различные источники информации, необходимые для проведения;- обосновывать актуальность теоретической и практической значимости исследуемой проблемы;-подготавливать, обосновывать и проводить научные исследования на основе анализа собранной аналитической информации, готовить презентации по результатам проведенного научного исследования. Имеет практический опыт: - установления на основе критического подхода причинно-следственных связей между исследуемыми явлениями и процессами;- использования современных методик расчета и анализа социально-экономических показателей, характеризующих экономические процессы и явления на уровне хозяйствующих субъектов, а также интерпретации полученных результатов о происходящих социально-экономических процессах и явлениях., - выстраивания и управления собственными приоритетами при реализации профессиональных видов деятельности ; - интерпретации полученных результатов в системе экономической безопасности.</p>
--	---

#### 4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 з.е., 144 ч., 24,5 ч. контактной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам
		в часах
		Номер семестра
		10
Общая трудоёмкость дисциплины	144	144
<i>Аудиторные занятия:</i>	16	16
Лекции (Л)	4	4
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	12	12
Лабораторные работы (ЛР)	0	0
<i>Самостоятельная работа (СРС)</i>	119,5	119,5
Выполнение и оформление РГР Задание 4	10	10
Подготовка к практическим занятиям (теоретические вопросы)	60	60
Выполнение и оформление РГР Задание 3	10	10
Выполнение и оформление РГР задание № 1	8	8
Подготовка к дифференцированному зачету	23,5	23.5
Выполнение и оформление РГР Задание 2	8	8
Консультации и промежуточная аттестация	8,5	8,5

Вид контроля (зачет, диф.зачет, экзамен)	-	диф.зачет
--	---	-----------

## 5. Содержание дисциплины

№ раздела	Наименование разделов дисциплины	Объем аудиторных занятий по видам в часах			
		Всего	Л	ПЗ	ЛР
1	Понятие финансового актива и его характеристики. Производные финансовые инструменты	6	2	4	0
2	Современная портфельная теория. Модели и методы оценки финансовых активов	6	2	4	0
3	Модели и методы оценки финансовых активов. Показатели эффективности управления портфелем.	4	0	4	0

### 5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Определения, основные характеристики и классификация финансовых активов. Понятие риска. Виды риска. Понятие и основные характеристики производных финансовых инструментов. Форвардные и фьючерсные контракты. Опционы. Опционные стратегии.	2
2	2	Понятие портфеля ценных бумаг. Виды портфелей ценных бумаг. Показатели доходности и риска портфеля ценных бумаг. Математическая модель формирования портфеля финансовых активов Г. Марковица. Модель оценки доходности финансовых активов (CAPM). Линия рынка капитала и линия рынка актива.	2

### 5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	1	Определения, основные характеристики и классификация финансовых активов. Понятие облигации. Расчет внутренней стоимости и доходности облигаций. Расчет доходности бескупонной облигации. Расчет показателей доходности и риска акции.	2
2	1	Расчет стоимости форвардного и фьючерсного контракта. Производные ценные бумаги: определения, общая характеристика. Формирование простых опционных стратегий. Формирование комбинированных опционных стратегий и расчет финансового результата.	2
3	2	Виды портфелей финансовых активов. Ожидаемая доходность портфеля финансовых активов. Расчет доходности и риска портфеля облигаций. Решение задач.	2
4	2	Модель формирования портфеля финансовых активов Г. Марковица. Решение задач.	2
5	3	Эффективный набор портфелей. Эффективная граница портфелей. Формирование эффективных портфелей. Моделирование эффективной границы портфеля с помощью функции "Поиск решения" в MS Excel. Расчет коэффициента систематического риска портфеля, состоящего из пяти финансовых активов (акций) 2 способами: 1) по формуле; 2) как коэффициент регрессии с помощью функции "Анализ данных" в MS Excel.	2

6	3	Расчет относительных показателей оценки эффективности управления портфелем. Решение задач. Переоцененные и недооцененные финансовые активы (коэффициент альфа актива). Решение задач.	2
---	---	---	---

### 5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

### 5.4. Самостоятельная работа студента

Выполнение СРС			
Подвид СРС	Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц) / ссылка на ресурс	Семестр	Кол-во часов
Выполнение и оформление РГР Задание 4	Воронина С.В. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, темы 22-24. Стр. 42-49	10	10
Подготовка к практическим занятиям (теоретические вопросы)	Воронина С.В. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, темы 1-24.	10	60
Выполнение и оформление РГР Задание 3	Воронина С.В. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, темы 10-17. Стр. 21-42	10	10
Выполнение и оформление РГР задание № 1	Воронина С.В. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, темы 1,3. Стр. 6-8	10	8
Подготовка к дифференцированному зачету	1,2 и конспект лекций по дисциплине Риски управления портфелем финансовых активов,	10	23,5
Выполнение и оформление РГР Задание 2	Воронина С.В. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, темы 7-9. Стр. 12-21	10	8

## 6. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации

Контроль качества освоения образовательной программы осуществляется в соответствии с Положением о балльно-рейтинговой системе оценивания результатов учебной деятельности обучающихся.

### 6.1. Контрольные мероприятия (КМ)

№ КМ	Се-местр	Вид контроля	Название контрольного мероприятия	Вес	Макс. балл	Порядок начисления баллов	Учитывается в ПА
1	10	Текущий контроль	РГР Задание 1	0,2	5	Студенту предлагается выполнить расчетно-графическое задание (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела	дифференцированный зачет

					<p>1 данной рабочей программы. Критерии выставления баллов за задание: 5 баллов- расчетная и графическая части выполнены верно, грамотно сформулированы выводы; 4 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, выводы сформулированы с неточностями и имеются недочеты не влияющие на конечный результат; 3 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, но неверно сформулированы выводы, в графической и расчетной части имеются неточностями и недочеты; 2 балла - в расчетной части есть замечания, неверно сформулированы выводы, метод выполнения графической части выбран верный; 1 балл - в расчетной и графической частях есть грубые замечания, неверно сформулированы выводы; 0 баллов - работа не представлена или содержит грубые ошибки. Весовой коэффициент мероприятия 0,2</p>		
2	10	Текущий контроль	РГР Задание2	0,2	5	<p>Студенту предлагается выполнить расчетно-графическое задание (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела 3 данной рабочей программы. Критерии выставления баллов за задание: 5 баллов- расчетная и графическая части выполнены верно, грамотно сформулированы выводы; 4 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, выводы</p>	дифференцированный зачет

						<p>сформулированы с неточностями и имеются недочеты не влияющие на конечный результат;  3 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, но неверно сформулированы выводы, в графической и расчетной части имеются неточностями и недочеты;  2 балла - в расчетной части есть замечания, неверно сформулированы выводы, метод выполнения графической части выбран верный;  1 балл - в расчетной и графической частях есть грубые замечания, неверно сформулированы выводы;  0 баллов - работа не представлена или содержит грубые ошибки.  Весовой коэффициент мероприятия 0,2</p>	
3	10	Текущий контроль	РГР задание 3	0,2	5	<p>Студенту предлагается выполнить расчетно-графическое задание (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела 3-6 данной рабочей программы.  Критерии выставления баллов за задание:  5 баллов- расчетная и графическая части выполнены верно, грамотно сформулированы выводы;  4 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, выводы сформулированы с неточностями и имеются недочеты не влияющие на конечный результат;  3 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, но неверно сформулированы выводы, в графической и расчетной части имеются неточностями и недочеты;  2 балла - в расчетной</p>	дифференцированный зачет

						<p>части есть замечания, неверно сформулированы выводы, метод выполнения графической части выбран верный;  1 балл - в расчетной и графической частях есть грубые замечания, неверно сформулированы выводы;  0 баллов - работа не представлена или содержит грубые ошибки.  Весовой коэффициент мероприятия 0,2</p>	
4	10	Текущий контроль	РГР задание 4	0,2	5	<p>Студенту предлагается выполнить расчетно-графическое задание (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела 3-6 данной рабочей программы.  Критерии выставления баллов за задание:  5 баллов- расчетная и графическая части выполнены верно, грамотно сформулированы выводы;  4 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, выводы сформулированы с неточностями и имеются недочеты не влияющие на конечный результат;  3 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, но неверно сформулированы выводы, в графической и расчетной части имеются неточностями и недочеты;  2 балла - в расчетной части есть замечания, неверно сформулированы выводы, метод выполнения графической части выбран верный;  1 балл - в расчетной и графической частях есть грубые замечания, неверно сформулированы выводы;  0 баллов - работа не представлена или</p>	дифференцированный зачет

						содержит грубые ошибки. Весовой коэффициент мероприятия 0,2	
5	10	Текущий контроль	Решение задач по теме простые и комбинированные опционные стратегии	0,1	60	<p>Студенту предлагается решить 20 задач (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела 2 данной рабочей программы. За каждую задачу студент может получить максимум 3 балла.</p> <p>Критерии выставления баллов за задание: 3 балла - задача решена верно, верно сформулированы выводы; 2 балла - имеются незначительные погрешности в расчетах (арифметические ошибки), верно сформулированы выводы; 1 балл - присутствуют грубые ошибки в расчетах, неверно сформулированы выводы; 0 баллов - задача не решена или решена полностью неправильно, нет выводов.</p> <p>Весовой коэффициент мероприятия 0,05</p>	дифференцированный зачет
6	10	Текущий контроль	Теоретический письменный опрос	0,1	4	<p>Письменный опрос осуществляется на одном из последних занятий курса. Студенту предлагается ответить на 2 вопроса из списка контрольных вопросов (см. вложенный файл) по итогам освоения всех разделов данной рабочей программы. За каждый ответ на вопрос студент может получить максимум 2 балла. Время отведенное на опрос составляет 15 минут.</p> <p>Критерии выставления баллов за опросе: 2 балла - правильный ответ на вопрос ; 1 балл - частично правильный ответ на вопрос;</p>	дифференцированный зачет

						0 баллов - неправильный ответ на вопрос или нет ответа. Весовой коэффициент мероприятия 0,1	
7	10	Промежуточная аттестация	Тестирование для повышения рейтинга	-	40	При недостаточной и/или не устраивающей студента величине рейтинга ему может быть предложено пройти тестирование по основным разделам дисциплины. Тест состоит из 40 вопросов, позволяющих оценить сформированность компетенций. На ответы отводится 60 минут. Правильный ответ на вопрос соответствует 1 баллу. Неправильный ответ на вопрос соответствует 0 баллов. Максимальное количество баллов за промежуточную аттестацию - 40 баллов.	дифференцированный зачет

## 6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид промежуточной аттестации	Процедура проведения	Критерии оценивания
дифференцированный зачет	<p>На дифференцированном зачете происходит оценивание знаний, умений и приобретенного опыта обучающихся по дисциплине " Риски управления финансовыми активами" на основе полученных оценок за контрольно-рейтинговые мероприятия текущего контроля. При недостаточной и/или не устраивающей студента величине рейтинга ему может быть предложено пройти тестирование по основным разделам дисциплины. В результате складывается совокупный рейтинг студента, который дифференцируется в оценку и проставляется в ведомость, зачетную книжку студента. Отлично: Величина рейтинга обучающегося по дисциплине 85...100 % Хорошо: Величина рейтинга обучающегося дисциплине 75...84 % Удовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по дисциплине 60...74 % Неудовлетворительно: Величина рейтинга обучающегося по дисциплине 0...59 %. В результате складывается совокупный рейтинг студента, который дифференцируется в оценку и проставляется в ведомость, зачетную книжку студента. Оценка по дисциплине вносится в «Приложение к диплому специалиста».</p>	В соответствии с пп. 2.5, 2.6 Положения

## 6.3. Паспорт фонда оценочных средств



Компетенции	Результаты обучения	№ КМ						
		1	2	3	4	5	6	7
ПК-4	Знает: – понятийно-терминологический аппарат, характеризующий финансовые риски в деятельности хозяйствующих субъектов; – методы исследования рисков финансовых активов; – модели оценки портфелей финансовых активов.	+	+		+	+	+	+
ПК-4	Умеет: – проводить исследования рисков финансовых активов; – разрабатывать стратегии управления рисками финансовых активов; – оценивать риски управления портфелями финансовых активов.	+	+	+	+	+	+	+
ПК-4	Имеет практический опыт: – владения методами анализа доходности, риска и эффективности инвестиционных вложений в финансовые активы; – принятия решения по формированию портфеля финансовых активов и выработки рекомендаций по снижению риска портфеля.	+	+	+	+			+
ПК-8	Знает: – нормативные документы в сфере ПОД/ФТ при формировании портфеля финансовых активов хозяйствующих субъектов; – принципы и методы выбора источников финансирования с учетом обязательного контроля в сфере ПОД/ФТ; – методы выявления и идентификации рисков при управлении финансовыми активами с учетом сведений об операциях (сделках), подлежащих обязательному контролю в сфере ПОД/ФТ.							++
ПК-8	Умеет: – проводить анализ рыночных и специфических рисков, в том числе при принятии решений об инвестировании в финансовые активы с учетом обязательного контроля в сфере ПОД/ФТ; - осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для принятия решений по операциям (сделкам), подлежащим контролю в сфере ПОД/ФТ; – оценивать предлагаемые варианты управленческих решений по снижению рисков при осуществлении операций (сделок) с финансовыми активами, подлежащих обязательному контролю в сфере ПОД/ФТ.			++				++
ПК-8	Имеет практический опыт: – обработки данных, необходимых для решения профессиональных задач в области управления рисками финансовых активов с учетом обязательного контроля в сфере ПОД/ФТ; – владения методами снижения степени финансовых рисков при управлении финансовыми активами, в т.ч. при операциях (сделках), подлежащих обязательному контролю в сфере ПОД/ФТ.			+				+

Типовые контрольные задания по каждому мероприятию находятся в приложениях.

## 7. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### Печатная учебно-методическая документация

#### а) основная литература:

1. Рынок ценных бумаг Учеб. для экон. специальностей вузов В. А. Галанов, А. И. Басов, З. К. Голда; Под ред. В. А. Галанова, А. И. Басова; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова; Рос. экон. акад. им. Г. В. Плеханова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Финансы и статистика, 2001. - 446,[1] с.

#### б) дополнительная литература:

1. Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций [Текст] А. С. Шапкин. - 6-е изд. - М.: Дашков и К, 2007. - 543 с. ил.

#### в) отечественные и зарубежные журналы по дисциплине, имеющиеся в библиотеке:

Не предусмотрены

г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:

1. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания к практическим занятиям / сост. С.В. Воронина под редакцией А.В. Карпушкиной. – Челябинск: Издательский центр ЮУрГУ, 2021. – 49 с.

из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:

1. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания к практическим занятиям / сост. С.В. Воронина под редакцией А.В. Карпушкиной. – Челябинск: Издательский центр ЮУрГУ, 2021. – 49 с.

### Электронная учебно-методическая документация

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Методические пособия для самостоятельной работы студента	Электронный каталог ЮУрГУ	Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания к практическим занятиям / сост. С.В. Воронина под редакцией А.В. Карпушкиной. – Челябинск: Издательский центр ЮУрГУ, 2021. – 49 с. <a href="https://lib.susu.ru/Resursy/Elektronnye_resursy">https://lib.susu.ru/Resursy/Elektronnye_resursy</a>
2	Основная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски: Оценка, управление, портфель инвестиций : учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. — 9-е изд. — Москва : Дашков и К, 2016. — 544 с. <a href="https://e.lanbook.com/book/93337">https://e.lanbook.com/book/93337</a>
3	Дополнительная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Курилова, А. А. Управление инвестиционным портфелем : учебное пособие / А. А. Курилова. — Тольятти : ТГУ, 2018. — 92 с. <a href="https://e.lanbook.com/book/139782">https://e.lanbook.com/book/139782</a>

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Windows(бессрочно)
2. Microsoft-Office(бессрочно)
3. ФГАОУ ВО "ЮУрГУ (НИУ)"-Портал "Электронный ЮУрГУ" (<https://edu.susu.ru>)(бессрочно)

Перечень используемых профессиональных баз данных и информационных справочных систем:

Нет

### 8. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
Практические занятия и семинары	126 (3б)	Компьютерное оборудование на 27 рабочих мест с доступом в сеть Интернет, рабочее место преподавателя: монитор, компьютер с доступом

		в сеть Интернет, учебная доска, мультимедиа-проектор, экран.
Контроль самостоятельной работы	113 (3б)	Компьютерное оборудование на 24 рабочих места с доступом в сеть Интернет, рабочее место преподавателя: моноблок с доступом в сеть Интернет, Smart- доска, мультимедийная панель, специализированный информационно-аналитический программный комплекс.
Лекции	142 (3б)	Рабочее место преподавателя: компьютер с выходом в Интернет, монитор. Учебная доска, экран, мультимедиа-проектор, микрофон, видео- акустическая система, документ-камера, аудио коммутатор, пульт управления (видео-аудио-экран).
Самостоятельная работа студента	126 (3б)	Компьютерное оборудование на 27 рабочих мест с доступом в сеть Интернет, рабочее место преподавателя: монитор, компьютер с доступом в сеть Интернет, учебная доска, мультимедиа-проектор, экран.
Зачет, диф.зачет	126 (3б)	Компьютерное оборудование на 27 рабочих мест с доступом в сеть Интернет, рабочее место преподавателя: монитор, компьютер с доступом в сеть Интернет, учебная доска, мультимедиа-проектор, экран.