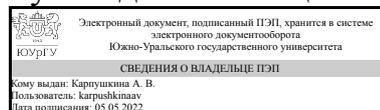


УТВЕРЖДАЮ:  
Руководитель специальности



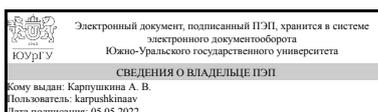
А. В. Карпушкина

## 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

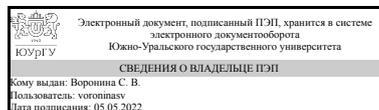
Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность, утверждённым приказом Минобрнауки от 14.04.2021 № 293

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.04 Теневая экономика,            1.Ф.06 Оценка рисков в экономической безопасности,            1.Ф.07 Практикум по виду профессиональной деятельности,            1.Ф.11 Кадровое обеспечение экономической безопасности,            1.Ф.10 Комплаенс-контроль,            1.Ф.02 Организация конфиденциального документооборота,            1.Ф.08 Инвестиционная политика предприятия, 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.07 Практикум по виду профессиональной	Знает: –основные методы сбора, обработки,

<p>деятельности</p>	<p>накопления и анализа информации, используемой для принятия решений по предупреждению и нейтрализации угроз экономической безопасности предприятия; (6 семестр) - содержание и основные показатели финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов, характеризующие эффективность их деятельности и нацеленные на выявление рисков и угроз экономической безопасности (7 семестр) - предпринимательские риски и угрозы экономической безопасности предприятия, методы анализа и оценки возможных предпринимательских рисков. (8 семестр), методологию сбора, обработки и оценки информации в целях определения потенциальных и реальных угроз экономической безопасности организации; (8 семестр). Умеет: – анализировать и интерпретировать содержащуюся в учетно-отчетной документации информацию, использовать полученные сведения для принятия решений по предупреждению и нейтрализации угроз экономической безопасности предприятия; (6 семестр)- проводить расчет и анализ основных показателей финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов, нацеленных на выявление рисков и угроз экономической безопасности этих хозяйствующих субъектов (7 семестр) - анализировать результаты расчетов, исследовать и обобщать причины и последствия выявленных отклонений, нарушений и недостатков и готовить предложения, направленные на их устранение. (8 семестр). Имеет практический опыт: – разработки ключевых показателей эффективности и мер по их достижению в целях повышения эффективности управления организацией; (6 семестр) - анализа и оценки рисков экономической безопасности и их последствий, составления и обоснования прогнозов основных угроз экономической безопасности. (8 семестр), - анализа и интерпретации экономической информации, использования полученных сведений для принятия решений по предупреждению, локализации и нейтрализации угроз экономической безопасности предприятия; (8 семестр)</p>
<p>1.Ф.11 Кадровое обеспечение экономической безопасности</p>	<p>Знает: - нормативную базу в сфере ПОД/ФТ; - методические и организационно-управленческие подходы к организации системы ПОД/ФТ хозяйствующих субъектов., - теоретические основы планирования, организации и процесса управления персоналом предприятия;- методы контроля и учета результатов деятельности персонала предприятия. Умеет: - разрабатывать правила деятельности персонала в целях</p>

	<p>ПОД/ФТ на предприятии; - организовывать работу по реализации правил деятельности персонала в целях ПОД/ФТ на предприятии. , - организовывать работу подчинённых в целях обеспечения экономической безопасности предприятия; - оценивать результаты деятельности подчинённых с точки зрения экономической безопасности предприятия, планировать и организовывать служебную деятельность подчиненных, осуществлять контроль и учет ее результатов. 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., - разработки планов служебной деятельности подчинённых в целях обеспечения экономической безопасности предприятия;- оценки результатов деятельности подчинённых с точки зрения обеспечения экономической безопасности предприятия;- разработки локальных нормативных актов касающихся организации труда (правила внутреннего трудового распорядка, положение об отпусках, положение о командировках и пр.)</p>
1.Ф.04 Теневая экономика	<p>Знает: - правовые и организационно-экономические средства предупреждения и пресечения теневизации экономической деятельности, определять виды и формы ответственности лиц при ведении теневой деятельности; - детерминанты теневой деятельности, особенности их проявления в механизме преступного поведения. Умеет: - формулировать цели и задачи в области политики противодействия теневой экономике, в т.ч. в сфере ПОД/ФТ; - использовать методологические и теоретические подходы для выявления и устранения причин, способствующих проявлениям теневизации экономики. Имеет практический опыт: - оперирования данными отечественной и зарубежной статистики, современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных о проявлениях теневой деятельности в экономических процессах и явлениях в России и мире., - выявления на основе нормативной документации закономерностей проявления теневизации экономики; профилактики, предупреждения преступлений и иных правонарушений в сфере экономики в т.ч. в сфере ПОД/ФТ, определения видов и форм ответственности за ведение теневой деятельности.</p>
1.Ф.10 Комплаенс-контроль	<p>Знает: - нормативную базу в сфере ПОД/ФТ; - методические и организационно-управленческие</p>

	<p>подходы к организации системы ПОД/ФТ хозяйствующих субъектов., - сущность и виды комплаенс-рисков, методические подходы к оценке и управлению комплаенс-рисками. Умеет: - - разрабатывать правила комплаенс- контроля в целях ПОД/ФТ в организации; - организовывать работу по реализации правил 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: - разработки внутренних стандартов и методик комплаенс-контроля., - 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., - обеспечения управления и минимизации комплаенс- риска, осуществления мониторинга эффективности управления комплаенс- риском.</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; - 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. Умеет: - рассчитывать комплекс показателей оценки рисков., - 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. Имеет практический опыт: - оценки вероятности попадания экономических показателей деятельности организации в рискованный и угрожающий диапазон., - 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, построения карты рисков (матрицы рисков) по</p>

	критериям вероятности реализации и потенциальной угрозы.
1.Ф.02 Организация конфиденциального документооборота	<p>Знает: - понятие тайны и иных охраняемых законом тайн, сведений, составляющих государственную и коммерческую тайну и сведений конфиденциального характера;- нормативно-правовые документы в области защиты государственной и коммерческой тайны, обеспечения режима секретности., - порядок организации документирования и документооборота в области защиты государственной и коммерческой тайны хозяйствующих субъектов. Умеет: - определять полномочия органов государственной власти и должностных лиц в области защиты государственной и коммерческой тайны;- оценивать риски и угрозы экономической безопасности, возникающие в случаях нарушения защиты государственной и коммерческой тайны, обеспечения режима секретности., -анализировать состав документации хозяйствующих субъектов в соответствии с установленными требованиями в области защиты государственной и коммерческой тайны в целях выявления и контроля рисков и угроз экономической безопасности. Имеет практический опыт: - ведения конфиденциального документооборота хозяйствующего субъекта., -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., - обработки полученной информации для обеспечения защиты государственной и коммерческой тайны и соблюдения режима секретности в деятельности хозяйствующих субъектов.</p>
1.Ф.08 Инвестиционная политика предприятия	<p>Знает: – этапы разработки инвестиционной политики предприятия в соответствии со стратегическими целями;– этапы инвестиционного проектирования;– 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: – использовать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию для разработки и принятия решений по формированию инвестиционной политики предприятия;– разрабатывать различные варианты управленческих решений по вопросам инвестиционной политики компании и обосновывать их целесообразность.,</p>

	<p>– 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: – разработки бизнес-плана инвестиционного проекта, включая все мероприятия по его реализации;– оценки рисков предложенных инвестиционных решений., – оценки эффективности инвестиционного проекта;– осуществления выбора оптимального инвестиционного проекта по критерию минимизации рисков.</p>
<p>Производственная практика, научно-исследовательская работа (8 семестр)</p>	<p>Знает: - типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов., - сущность системного подхода в исследовательской и практической экономической деятельности., - методики проверки финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов. Умеет: - формировать систему данных, необходимых, для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов; - разрабатывать мероприятия по локализации и нейтрализации рисков и угроз в сфере экономической безопасности., - составлять прогнозы динамики основных экономических и социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов; - принимать оптимальные управленческие решения с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и угроз экономической безопасности хозяйствующего субъекта в соответствии с законодательством. Имеет практический опыт: - постановки задач и выбора путей их решения в своей проектной деятельности; - самостоятельного выбора форм представления результатов проектной деятельности в т.ч. в форме презентации., - применения методов оценки уровня рисков и угроз экономической безопасности., - выявления и использования взаимосвязи и взаимозависимости экономических и правовых явлений для выявления и контроля рисков и угроз экономической безопасности, предупреждения и пресечения правонарушений в сфере профессиональной экономической деятельности.</p>

#### 4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 з.е., 144 ч., 16,25 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>	119,75	119,75	
с применением дистанционных образовательных технологий	0		
Подготовка к дифференцированному зачету	23,75	23.75	
Выполнение и оформление РГР Задание 3	10	10	
Выполнение и оформление РГР задание № 1	8	8	
Подготовка к практическим занятиям (теоретические вопросы)	60	60	
Выполнение и оформление РГР Задание 2	8	8	
Выполнение и оформление РГР Задание 4	10	10	
Консультации и промежуточная аттестация	8,25	8,25	
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	2

		доходности финансовых активов (CAPM). Линия рынка капитала и линия рынка актива.	
--	--	--	--

## 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
Подготовка к дифференцированному зачету	1,2 и конспект лекций по дисциплине Риски управления портфелем финансовых активов,	10	23,75
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 практическим занятиям (теоретические вопросы)	Воронина С.В. Риски управления портфелем финансовых активов:	10	60

	методические указания, темы 1-24.		
Выполнение и оформление РГР Задание 2	Воронина С.В. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, темы 7-9. Стр. 12-21	10	8
Выполнение и оформление РГР Задание 4	Воронина С.В. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, темы 22-24. Стр. 42-49	10	10

## 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 Задание1	0,2	5	Студенту предлагается выполнить расчетно-графическое задание (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела 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	дифференцированный зачет

						<p>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 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>	дифференцированный зачет

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.</p> <p>Критерии выставления баллов за задание:</p> <p>5 баллов- расчетная и графическая части выполнены верно, грамотно сформулированы выводы;</p> <p>4 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, выводы сформулированы с неточностями и имеются недочеты не влияющие на конечный результат;</p> <p>3 балла - расчетная и графическая части выполнены верно, но неверно сформулированы выводы, в графической и расчетной части имеются неточностями и недочеты;</p> <p>2 балла - в расчетной части есть замечания, неверно сформулированы выводы, метод выполнения графической части выбран верный;</p> <p>1 балл - в расчетной и графической частях есть грубые замечания, неверно сформулированы выводы;</p> <p>0 баллов - работа не представлена или содержит грубые ошибки.</p> <p>Весовой коэффициент мероприятия 0,2</p>	дифференцированный зачет
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.</p> <p>Критерии выставления баллов за задание:</p> <p>5 баллов- расчетная и графическая части выполнены верно,</p>	дифференцированный зачет

					<p>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>		
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. 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;</p>	дифференцированный зачет

						0 баллов - задача не решена или решена полностью неправильно, нет выводов. Весовой коэффициент мероприятия 0,05	
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. Критерии выставления баллов за опросе:</p> <p>2 балла - правильный ответ на вопрос ;</p> <p>1 балл - частично правильный ответ на вопрос;</p> <p>0 баллов - неправильный ответ на вопрос или нет ответа.</p> <p>Весовой коэффициент мероприятия 0,1</p>	дифференцированный зачет
7	10	Промежуточная аттестация	Тестирование для повышение рейтинга	-	40	<p>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.</p>	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	Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски: Оценка, управление, портфель инвестиций : учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. — 9-е изд. —

		издательства Лань	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)

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
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).
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.
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.
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.