ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:
Руководитель специальности

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Карпушкина А. В.
Пользователь: karpushkinaav
Дата подписания: 10.06.2024

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.

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Карпушкина А. В.
Пользователь: karpushkinaav
Дата подписания: 10.06.2024

А. В. Карпушкина

Разработчик программы,
к.экон.н., доцент

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе электронного документооборота Южно-Уральского государственного университета
СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП
Кому выдан: Воронина С. В.
Пользователь: voroninasv
Дата подписания: 10.06.2024

С. В. Воронина

Челябинск

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;

(сделках), подлежащих обязательному контролю в сфере ПОД/ФТ, устанавливать виды и формы ответственности работников организации, принимать решения по устранению выявленных нарушений.	– 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.

3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

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

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

Дисциплина	Требования
1.Ф.08 Инвестиционная политика предприятия	Знает: – методы и модели оценки рисков инвестиционного проекта. 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. Имеет практический опыт: – осуществления выбора оптимального инвестиционного проекта по критерию минимизации рисков., - оценки рисков предложенных инвестиционных решений.
1.Ф.14 Комплексный анализ хозяйственной деятельности	Знает: - основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов и позволяющих провести комплексную оценку их хозяйственного и финансового состояния. Умеет: -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: - сбора, обработки и изучения данных, составляющих базы информационного обеспечения комплексного анализа деятельности хозяйствующих субъектов;- оценки показателей деятельности хозяйствующих субъектов и их бизнес-единиц.
1.Ф.04 Теневая экономика	Знает: - основные социально-экономические подходы к исследованию феномена теневой экономики; - 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: - 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; - разрабатывать и проводить мероприятия по противодействию теневизации экономики, легализации криминальных доходов. Имеет практический опыт: - 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; - 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.
1.Ф.06 Оценка рисков в экономической безопасности	Знает: - методы расчета финансово-экономических показателей при выявлении, оценке и прогнозировании рисков деятельности организации., - 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 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. Умеет: - прогнозировать показатели рисков и обосновывать уровень достоверности построенного прогноза , - 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 и ожидаемого ущерба экономической безопасности, построения карты рисков (матрицы рисков) по критериям вероятности реализации и потенциальной угрозы.
1.Ф.07 Практикум по виду профессиональной деятельности	Знает: - методологию сбора, обработки и оценки информации в целях определения потенциальных и реальных угроз экономической безопасности организации (информационно-аналитический вид деятельности);- содержание и методику расчета экономических показателей, характеризующих деятельность конкретного хозяйствующего субъекта. (расчетно-экономический вид деятельности);- порядок работы в информационно-аналитических системах, возможности их использования для расчета экономических показателей,

	характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов, нормативного обеспечения и внедрения системы управления рисками (информационно-аналитический вид деятельности), - содержание и основные показатели финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов, характеризующие эффективность их деятельности и нацеленные на выявление рисков и угроз экономической безопасности (расчетно-экономический вид деятельности)- информационно- аналитические методы построения системы индикаторов экономической безопасности и оценки возможных рисков и угроз (информационно-аналитический вид деятельности) Умеет: - проводить экономические и социально-экономические исследования эффективности финансово-хозяйственной деятельности компании с целью определения и предотвращения угроз экономической безопасности организации. (расчетно-экономический вид деятельности):- анализировать результаты расчетов, исследовать и обобщать причины и последствия выявленных отклонений, нарушений и недостатков и готовить предложения, направленные на их устранение. (организационно-управленческий вид деятельности)- собирать и группировать исходные данные для расчета экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов. (расчетно-экономический вид деятельности); - проводить расчет и анализ основных показателей финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующих субъектов, нацеленных на выявление рисков и угроз экономической безопасности этих хозяйствующих субъектов (расчетно-экономический вид деятельности)- на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие экономическую безопасность хозяйствующих субъектов; (информационно-аналитический вид деятельности). Имеет практический опыт: - применения информационных технологий для анализа и интерпретации экономической информации, содержащейся в учетно-отчетной документации, использования полученных сведений для принятия решений по предупреждению, локализации и нейтрализации угроз экономической безопасности предприятия (информационно-аналитический вид деятельности); - разработки предложений по вопросам повышения эффективности деятельности хозяйствующих субъектов на

	основе расчета и анализа системы экономических показателей. (расчетно-экономический вид деятельности); - 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 (расчетно-экономический вид деятельности)- анализа рисков экономической безопасности и их последствий, составления и обоснования прогнозов основных угроз экономической безопасности с использованием программных инструментов (информационно-аналитический вид деятельности)
1.О.26 Контроль и ревизия	Знает: - методы и приемы контроля, методы и приемы экономического анализа в целях оценки эффективности и прогнозирования финансово-хозяйственной деятельности хозяйствующего субъекта; - способы, приемы и порядок работы с нормативными документами при анализе результатов контроля финансово-хозяйственной деятельности. Умеет: - использовать финансовые и нефинансовые источники информации для выявления отклонений и нарушений, касающихся деятельности предприятия и функционирования его активов;- идентифицировать микро-, мезо- и макроуровень административного и финансового контроля и характеризовать соответствующие каждому уровню виды рисков с целью их ограничения/нейтрализации. 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.
1.Ф.10 Комплаенс-контроль	Знает: - нормативную базу в сфере ПОД/ФТ; - методические и организационно-управленческие подходы к организации системы ПОД/ФТ хозяйствующих субъектов. Умеет: - разрабатывать правила комплаенс- контроля в целях ПОД/ФТ в организации; - организовывать работу по реализации правил комплаенс-контроля в целях ПОД/ФТ в организации. 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.
Производственная практика (научно-исследовательская работа) (8 семестр)	Знает: - комплекс цифровых технологий и информационно-аналитических методов

	построения системы индикаторов экономической безопасности и оценки возможных рисков и угроз - основные показатели, характеризующие деятельность экономических субъектов на макро, мезо – и микроуровнях. Умеет: - на основе цифровых технологий, программных средств и действующей нормативно-правовой базы рассчитывать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов; - выбирать и адаптировать методы анализа теоретического материала и практических данных в области экономической безопасности. Имеет практический опыт: - применения цифровых технологий и программных средств обработки экономических данных для решения стандартных задач профессиональной деятельности в области экономической безопасности- анализа рисков экономической безопасности и их последствий, составления и обоснования прогнозов основных угроз экономической безопасности с использованием программных инструментов, - 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.

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
Аудиторные занятия:	16	16
Лекции (Л)	4	4
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	12	12
Лабораторные работы (ЛР)	0	0
Самостоятельная работа (СРС)	119,5	119,5
Выполнение и оформление РГР Задание 3	10	10
Выполнение и оформление РГР задание № 1	8	8
Выполнение и оформление РГР Задание 2	8	8
Подготовка к дифференцированному зачету	23,5	23.5
Подготовка к практическим занятиям (теоретические	60	60

вопросы)		
Выполнение и оформление РГР Задание 4	10	10
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	2

		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.	
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 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
Выполнение и оформление РГР Задание 2	Воронина С.В. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, темы 7-9. Стр. 12-21	10	8
Подготовка к дифференцированному зачету	1,2 и конспект лекций по дисциплине Риски управления портфелем финансовых активов,	10	23,5
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 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	Учи-тыва-ется в ПА
1	10	Текущий контроль	РГР Задание1	0,2	5	Студенту предлагается выполнить расчетно-	дифференцированный зачет

						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 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	
2	10	Текущий контроль	РГР Задание2	0,2	5	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	дифференцированный зачет

						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	
3	10	Текущий контроль	РГР задание 3	0,2	5	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	дифференцированный зачет

						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	
4	10	Текущий контроль	РГР задание 4	0,2	5	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 содержит грубые ошибки. Весовой коэффициент мероприятия 0,2	дифференцированный зачет
5	10	Текущий контроль	Задание 5	0,2	60	Студенту предлагается решить 20 задач (см.	дифференцированный зачет

						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; 0 баллов - задача не решена или решена полностью неправильно, нет выводов. Весовой коэффициент мероприятия 0,05	
6	10	Текущий контроль	Теоретический письменный опрос	1	4	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: 2 балла - правильный ответ на вопрос ; 1 балл - частично правильный ответ на вопрос; 0 баллов - неправильный ответ на вопрос или нет ответа. Весовой коэффициент мероприятия 0,1	дифференцированный зачет
7	10	Проме-жуточная аттестация	Тестирование для повышение рейтинга	-	40	При недостаточной и/или не устраивающей студента величине рейтинга ему может быть предложено	дифференцированный зачет

						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.	

6.2. Процедура проведения, критерии оценивания

Вид промежуточной аттестации	Процедура проведения	Критерии оценивания
дифференцированный зачет	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».	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:

Не предусмотрена

б) дополнительная литература:

1. Козлова Е. А. Экономические и инвестиционные риски : учеб. пособие / Е. А. Козлова, И. Г. Шепелев ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экономика, упр. и инвестиции ; ЮУрГУ. - Челябинск : Издательство ЮУрГУ, 2005. - 73, [1] с.

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. https://lib.susu.ru/Resursy/Elektronnye_resursy
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. https://e.lanbook.com/book/93337
3	Дополнительная литература	Электронно-библиотечная система издательства Лань	Курилова, А. А. Управление инвестиционным портфелем : учебное пособие / А. А. Курилова. — Тольятти : ТГУ, 2018. — 92 с. https://e.lanbook.com/book/139782

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
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.
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.
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.
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.
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).