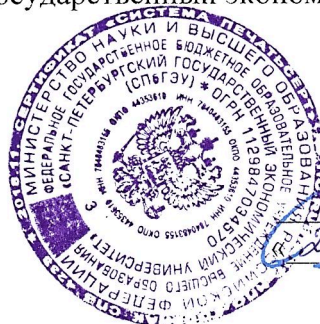


# МИНОБРНАУКИ РОССИИ

федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«Санкт-Петербургский государственный экономический университет»



УТВЕРЖДАЮ  
Проректор по образовательной  
деятельности  
В.Г. Шубаева  
20 23 г.

## Финансовый риск-менеджмент в условиях цифровизации

### Рабочая программа дисциплины

Направление подготовки/ Специальность 38.04.02 Менеджмент

Направленность (профиль) программы/ Специализация Финансовый менеджмент в цифровой экономике

Уровень высшего образования Магистратура

Форма обучения очная

Год набора 2023

Составитель(и):  
к.э.н, Хакимова Галия Ринатовна

Часов по учебному плану	144	<b>Виды контроля в семестрах:</b>  Экзамен: семестр 3
в том числе:		
контактная работа	32	
самостоятельная работа	76	
практическая подготовка	0	
часов на контроль	36	

#### Распределение часов дисциплины:

Семестр:	3
Вид занятий	Часы
Лекционные занятия	18
Практические занятия	14
Лабораторные работы	
<b>Итого аудиторных часов</b>	<b>32</b>
Самостоятельная работа	76
Часы на контроль	36
<b>Итого академических часов</b>	<b>144</b>
<b>Общая трудоемкость в зачетных единицах</b>	<b>4</b>

Санкт-Петербург  
2023

# СОДЕРЖАНИЕ

<b>1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ .....</b>	<b>3</b>
<b>2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ .....</b>	<b>3</b>
<b>3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ .....</b>	<b>3</b>
<b>4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ* .....</b>	<b>4</b>
<b>5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....</b>	<b>6</b>
<b>5.1 Рекомендуемая литература .....</b>	<b>7</b>
<b>5.2 Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в     т.ч. отечественного производства .....</b>	<b>7</b>
<b>5.3 Перечень информационных справочных систем (ИСС) и современных     профессиональных баз данных (СПБД).....</b>	<b>7</b>
<b>6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ .....</b>	<b>8</b>
<b>7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ.....</b>	<b>9</b>
<b>8. ОСОБЕННОСТИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ ДЛЯ ИНВАЛИДОВ И ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ .....</b>	<b>10</b>
<b>ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ.....</b>	<b>11</b>
<b>1.1 Контрольные вопросы и задания к промежуточной аттестации .....</b>	<b>11</b>
<b>1.2 Темы письменных работ.....</b>	<b>11</b>
<b>1.3 Контрольные точки .....</b>	<b>11</b>
<b>1.4 Другие объекты оценивания .....</b>	<b>12</b>
<b>1.5 Самостоятельная работа обучающегося .....</b>	<b>12</b>
<b>1.6 Шкала оценивания результата .....</b>	<b>12</b>

## 1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

<b>Цель:</b>	Получение системного представления о методах и приемах формирования информационно-аналитической базы для гибкого управления предприятиями, ориентированными на достижение устойчивого роста и эффективного развития, информационно-аналитической поддержки реализации оперативных и стратегических управленческих решений, ознакомление и работа с цифровыми решениями в риск-менеджменте
--------------	---

## 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Дисциплина Б1.В Финансовый риск-менеджмент в условиях цифровизации относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1.

## 3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Код и наименование компетенции выпускника	Код и наименование индикатора достижения компетенций	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-4 - Способен обеспечивать разработку, обоснование и реализацию решений в сфере управления финансами, включая управление рисками	ПК-4.2 - Способен организовывать процесс управления рисками на основе современной методологии риск-менеджмента, выстраивать и внедрять систему мониторинга рисков и угроз	Знать: методы и инструменты управления риском в финансовой и инвестиционной деятельности  Уметь: управлять рисками на основе современной методологии риск-менеджмента, выстраивать и внедрять систему мониторинга рисков и угроз.  Владеть: методами и моделями современной правил риск-менеджмента, навыками выстраивания системы мониторинга рисков и угроз.
ПК-2 - Способен обеспечивать стратегическую устойчивость финансовой системы предприятий и организаций в динамичных условиях	ПК-2.2 - Способен поддерживать стратегическую устойчивость компании и защиту от рисков на основе правового обеспечения	Знать: методы и модели стратегического менеджмента в применении к финансовой системе предприятия, правовые основы обеспечения финансовой и инвестиционной деятельности  Уметь: использовать современные технологии стратегического менеджмента в применении к финансовой системе предприятия с учетом правовых норм обеспечения финансовой и инвестиционной деятельности.

	финансовой и инвестиционной деятельности	Владеть: навыками организации финансовой системы предприятия, соответствующей целям и направлениям стратегического развития.
--	--	--

#### 4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ\*

Номер и наименование тем и/или разделов/тем	Содержание дисциплины	Объем дисциплины (академические часы)			
		Контактная работа			СРО
		ЗЛТ	ПЗ	ЛР	
Тема 1. Информационно-аналитическая обеспечения системы управления рисками, формы и методы её организации.	Понятия проблем, угроз, рисков в финансовой деятельности предприятия. Принципы рискозащищенности, планомерности, ответственности, адаптивности, интегрированной целостности для формирования требований к системе управления рисками и ее интеграции в общую систему управления и планирования. Состав и структура информационного обеспечения системы управления рисками. Тенденции в развитии информационных технологий, структура информационных потоков, классификация источников информации, принципы электронного документооборота. Требования к системе информационного обеспечения Система моделей поддержки принятия управленческих решений. Отечественные и зарубежные информационные технологии. Роль анализа внешней среды и управленческого учета.	2	1		12
Тема 2. Управление финансовым риском	Причины возникновения рисков. Чистые и спекулятивные риски. Торговые, производственные, имущественные, транспортные, политические, экологические, природные риски и причины их возникновения. Транспортные (логистические) риски и их классификация в соответствии с правилами международной торговой палаты Инкотермс. Финансовые и коммерческие риски, как составная часть спекулятивных рисков. Риски связанные с покупательной способностью денег: инфляционные, дефляционные, валютные риски и риски ликвидности. Инвестиционные риски и их подвиды: риск упущенной выгоды, риск снижения доходности, риск прямых финансовых потерь, капитальный риск, страновой риск, временной риск. Кредитные риски и их классификация. Прочие виды рисков. Эволюция отношения к риску в человеческом обществе. История возникновения менеджмента рисков. Переход от страхования рисков к их управлению. Показатель стоимостной оценки риска (VAR). Фрагментарная и интегрированная (корпоративная) модели управления риском. Современные концепции управления риском. Понятие риск-менеджмента. Парадигмы реализации риск-менеджмента «снизу	2	1		12

	вверх» и «сверху вниз». Жизненный цикл организации и выбор модели управления рисками. Управления рисками как процесс. Логическая схема построения и работы системы управления рисками. Схема управления рисками (процесс РМ) по версии Федерации европейских ассоциаций риск-менеджеров (FERMA).				
Тема 3. Построение эффективной системы управления финансовыми рисками для предприятий	Основные принципы организации системы управления рисками предприятия. Оценка влияния хозяйственных рисков на эффективность и стоимость бизнеса. Практика организации системы управления рисками на предприятиях ключевых отраслей промышленности. Методы и приемы учета рисков при обосновании стратегических и оперативных управленческих решений в условиях турбулентного состояния среды. Реинжиниринг и кайдзен бизнес-процессов как направление снижения разрушительного воздействия рисков на стоимость бизнеса. Экспертные оценки при оценке перспектив реализации проектов и модели оценки операционных бизнес-единиц. Методика COSO при разработке системы внутреннего контроля и управления финансовыми рисками. Виды внутреннего контроля и методические приемы его осуществления. Формы организации системы внутреннего контроля. Содержание задач оперативного анализа, планирования и упреждающего контроля. Формы и методы разработки оперативных планов на предприятиях (внутрихозяйственных подразделениях). Особенности предпланового, оперативного и итогового анализа в зависимости от управленческих задач (планирования, бюджетирования).	3	2		12
Тема 4. Оценка финансовых рисков	Идентификация риска, как процесс определения, составления перечня и описания элементов риска. Описание и источники риска. Организация и ее внутренняя и внешняя среда. Внутренние и внешние источники информации для идентификации рисков. Реестр (журнал) рисков и способы его создания. Руководство по созданию реестра риска организации Р 50.1.084 – 2011. Количественная оценка (измерение) риска. Дискретные и непрерывные модели риска. Распределения случайных величин, используемые при оценке рисков. Последствия и их числовые показатели. Числовые показатели последствий экономических рисков. Методы измерения риска: статистические, вероятностно-статистические, теоретико-вероятностные, экспертные. Концепция приемлемого риска, принцип ALARA/ALARP. Субъективность риска. Модель Неймана-Моргенштерна восприятия риска. Основы теории вероятностей, математической статистики и теории случайных процессов, используемые в теории рисков: вероятностные распределения (нормальное, гамма-распределение, Вейбулла, логнормальное, распределения Гумбеля, бэта-распределения) байесовские вероятности, условные вероятности,	3	4		12

	марковские процессы, теория очередей и т. д. Модели теории графов и математической логики: булева алгебра, деревья, автоматные функции.				
Тема 5. Мониторинг и управление финансовыми рисками. Принятие управленческих решений в условиях определенности, риска и неопределенности	Управление рисками, как область стандартизации и средство повышения эффективности работы предприятия. Стандарты в риск-менеджменте. Понятие мониторинга рисков. Два основных типа стандартов управления рисками: стандарты оценки результатов и стандарты оценки деятельности. Разработка модели внутрифирменной системы риск-менеджмента. Понятие «политики управления рисками». Проверка соблюдения стандартов. Анализ задач и методов теории принятия решений, особенности принятия решений в управлении. Принятие решений без использования численных значений вероятностей исходов (в условиях определенности), принятие решений с использованием численных значений вероятностей исходов (в условиях неопределенности). Дерево управленческих решений.	4	2		12
Тема 6. Имитационные модели для анализа и управления рисками. Основы имитационного стохастического моделирования. Построения имитационных моделей для анализа рисков. Использование электронных таблиц для построения имитационных моделей. Использование Anylogic	Понятие стохастической имитационной модели. Моделирование рисков событий. Использование преобразования Смирнова для построения случайных возмущений с заданными распределениями. Построения имитационных моделей для анализа рисков в финансовой математике. Построения имитационных моделей для анализа рисков в производственной деятельности. Построения имитационных моделей для анализа рисков в деятельности торгового предприятия. Применение электронных таблиц для построения имитационных моделей. Использование Anylogic для построения имитационных моделей. Использование дискретно-событийное моделирования для учета риска.	4	4		16
<b>Контроль:</b>					<b>36</b>
<b>Всего по дисциплине:</b>		<b>18</b>	<b>14</b>	<b>0</b>	<b>76</b>

\*ЗЛТ – занятия лекционного типа, ПЗ – все виды занятий семинарского типа, кроме лабораторных работ, ЛР – лабораторные работы, СРО – самостоятельная работа обучающегося

## 5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

## 5.1 Рекомендуемая литература

Библиографическое описание издания (автор, заглавие, вид, место и год издания, кол. стр.)	Электронные ресурсы
Авдийский В.И. Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методология анализа, прогнозирования и управления: учебное пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных; Финуниверситет. — Москва: Альфа-М; Инфра-М, 2013. — 368 с. — То же [Электронный ресурс]. — Режим доступа: <a href="http://znanium.com/catalog/product/394136">http://znanium.com/catalog/product/394136</a> .	<a href="http://znanium.com/catalog/product/394136">http://znanium.com/catalog/product/394136</a> .
Батыршин И.З. Нечеткие гибридные системы. Теория и практика [Электронный ресурс] / И.З. Батыршин [и др.]. — Москва: Физматлит, 2007. — 208 с. — Режим доступа: <a href="http://znanium.com/catalog/product/544667">http://znanium.com/catalog/product/544667</a> .	<a href="http://znanium.com/catalog/product/544667">http://znanium.com/catalog/product/544667</a> .
Борисов В.В. Нечеткие модели и сети [Электронный ресурс] / В.В.Борисов [и др.]. — Москва: Горячая линия-Телеком, 2012. — 284 с. — Режим доступа: <a href="http://znanium.com/catalog/product/367553">http://znanium.com/catalog/product/367553</a> .	<a href="http://znanium.com/catalog/product/367553">http://znanium.com/catalog/product/367553</a> .
Дамодаран А. Инвестиционная оценка. Инструменты и методы оценки любых активов [Электронный ресурс]: пер. с англ. / А. Дамодаран. — 5-е изд. — Москва : Альпина Бизнес Букс, 2008. — Режим доступа: <a href="http://znanium.com/go.php?id=524407">http://znanium.com/go.php?id=524407</a>	<a href="http://znanium.com/go.php?id=524407">http://znanium.com/go.php?id=524407</a>

## 5.2 Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в т.ч. отечественного производства

- 7-Zip
- LibreOffice
- ОС Альт образование 10

## 5.3 Перечень информационных справочных систем (ИСС) и современных профессиональных баз данных (СПБД)

№	Наименование СПБД/ ИСС
1.	Электронная библиотека Grebennikon.ru – <a href="http://www.grebennikon.ru">www.grebennikon.ru</a>
2.	Научная электронная библиотека eLIBRARY – <a href="http://www.elibrary.ru">www.elibrary.ru</a>
3.	Научная электронная библиотека КиберЛеника – <a href="http://www.cyberleninka.ru">www.cyberleninka.ru</a>
4.	База данных ПОЛПРЕД Справочники – <a href="http://www.polpred.com">www.polpred.com</a>
5.	База данных OECD Books, Papers & Statistics на платформе OECD iLibrary <a href="http://www.oecd-ilibrary.org">www.oecd-ilibrary.org</a>
6.	Справочная правовая система КонсультантПлюс (инсталлированный ресурс)

	СПбГЭУ или <a href="http://www.consultant.ru">www.consultant.ru</a> )
7.	Справочная правовая система «ГАРАНТ» (инсталлированный ресурс СПбГЭУ или <a href="http://www.garant.ru">www.garant.ru</a> )
8.	Информационно-справочная система «Кодекс» (инсталлированный ресурс СПбГЭУ или <a href="http://www.kodeks.ru">www.kodeks.ru</a> )
9.	Электронная библиотечная система BOOK.ru - <a href="http://www.book.ru">www.book.ru</a>
10.	Электронная библиотечная система ЭБС ЮРАЙТ – <a href="http://www.urait.ru">www.urait.ru</a>
11.	Электронно-библиотечная система ЗНАНИУМ (ZNANIUM) – <a href="http://www.znanium.com">www.znanium.com</a>
12.	Электронная библиотека СПбГЭУ – <a href="http://opac.unicon.ru">opac.unicon.ru</a>

## 6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для реализации данной дисциплины имеются специальные помещения для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ) групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы.

Помещения оснащены оборудованием и техническими средствами обучения.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду университета.

Наименование учебных аудиторий, перечень	Адрес (местоположение) учебных аудиторий
Ауд. 207 Учебная аудитория (для проведения занятий лекционного типа и занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации), оборудована мультимедийным комплексом. Специализированная мебель и оборудование: Учебная мебель на 48 посадочных мест; доска меловая 1 шт.; тумба; Компьютер Intel i5 X4 4460 3.2Gh/8Gb/1Tb - 1 шт., Проектор цифровой Acer X1240 - 1 шт., Микшер-усилитель ТА-1120 - 1 шт., Акустическая система JBL CONTROL 25 WH - 2 шт., Экран 183x240 . - 1 шт. Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий: мультимедийные приложения к лекционным курсам и практическим занятиям, интерактивные учебно-наглядные пособия.	196084, г. Санкт-Петербург, Московский пр., д. 103, лит. А, пом. 1Н, 2Н
Ауд. 401 пом 1 Лаборатория "Лабораторный комплекс". Специализированная мебель и оборудование: Учебная мебель на 25 посадочных мест; Компьютер I3-8100/ 8Гб/500Гб/ Philips224E5QSB - 20 шт., Ноутбук HP 250 G6 1WY58EA - 5 шт., Проектор цифровой Acer X1240 - 1 шт., Экран с электроприводом 160x210 см - 1 шт. Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий: мультимедийные приложения к лекционным курсам и практическим занятиям, интерактивные учебно-наглядные пособия.	196084, г. Санкт-Петербург, Московский пр., д. 103, лит. А, пом. 1Н, 2Н



## **7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ**

Приступая к изучению дисциплины, обучающемуся необходимо ознакомиться со следующими документами:

- учебно-методической документацией;
- локальными нормативными актами, регламентирующими основные вопросы организации и осуществления образовательной деятельности, в том числе регламентирующие порядок проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся;
- графиком консультаций сотрудников профессорско-преподавательского состава.

Уровень и глубина освоения дисциплины определяются активной и систематической работой обучающихся на лекционных занятиях, занятиях семинарского типа, выполнением самостоятельной работы, в том числе в части выделения наиболее значимых и актуальных проблем для дальнейшего изучения. Особым условием качественного освоения дисциплины является эффективная организация труда, позволяющая распределить учебную нагрузку равномерно в соответствии с графиком учебного процесса.

При подготовке к учебным занятиям обучающимся предоставляется возможность посещения консультаций сотрудников профессорско-преподавательского состава СПбГЭУ согласно расписанию, установленному в графике консультаций.

Аудиторная и внеаудиторная работа обучающихся должна быть направлена на формирование:

- фундаментальных основ мировоззрения обучающихся и естественнонаучного познания;
- базисных знаний, соответствующих направлению подготовки и заявленной профессиональной области, формирующих целевую и профессиональную основу для подготовки кадров;
- профессиональных компетенций ориентированных на удовлетворение потребностей рынка труда;
- индивидуальной траектории посредством освоения уникального набора профессиональных компетенций дополняющих компетентностную модель обучающегося, за счет ориентации на конкретные профессиональные специализированные области знаний, определяемые представителями рынка труда;
- метанавыков обучающихся, таких как: командная работа и лидерство, анализ данных, цифровые навыки, разработка и реализация проектов, межкультурное взаимодействие.

## **8. ОСОБЕННОСТИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ ДЛЯ ИНВАЛИДОВ И ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ**

Обучение обучающихся с ограниченными возможностями здоровья при необходимости осуществляется на основе адаптированной рабочей программы с использованием специальных методов обучения и дидактических материалов, составленных с учетом особенностей психофизического развития, индивидуальных возможностей и состояния здоровья таких обучающихся (обучающегося).

В целях освоения учебной программы дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья Университет обеспечивает:

- для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по зрению: размещение в доступных для обучающихся, являющихся слепыми или слабовидящими, местах и в адаптированной форме справочной информации о расписании учебных занятий; присутствие ассистента, оказывающего обучающемуся необходимую помощь; выпуск альтернативных форматов методических материалов (крупный шрифт или аудиофайлы);

- для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья по слуху: надлежащими звуковыми средствами воспроизведение информации;

- для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья, имеющих нарушения опорно-двигательного аппарата: возможность беспрепятственного доступа обучающихся в учебные помещения, туалетные комнаты и другие помещения кафедры, а также пребывание в указанных помещениях.

Обучающиеся из числа инвалидов и лиц с ОВЗ обеспечены печатными и (или) электронными образовательными ресурсами в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья. Образование обучающихся с ограниченными возможностями здоровья может быть организовано как совместно с другими обучающимися, так и в отдельных группах или в отдельных организациях.

## **ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**

### **1.1 Контрольные вопросы и задания к промежуточной аттестации**

- 1 Экономическая сущность и виды финансовых рисков.
- 2 Понятие рыночного риска и его классификация.
- 3 Сущность и основные виды процентного риска.
- 4 Сущность валютного риска и основные его виды.
- 5 Понятие «кредитного риска», его классификация.
- 6 Основные виды внешнего кредитного риска и их сущность?
- 7 Сущность внутреннего кредитного риска и основные его виды.
- 8 Понятие риска дефолта, его классификация.
- 9 Категория «риска ликвидности» и его классификация.
- 10 Портфельный подход и диверсификация, как метод управления риском.
- 11 Метод хеджирования, как способ управления рисками.
- 12 Виды страхования финансовых рисков. Способы самострахования финансовых
- 13 Источники информации, используемые для оценки рыночных рисков.
- 14 Алгоритм управления финансовыми рисками.
- 15 Способы измерения и оценки финансовых рисков.
- 16 Применение методов оценки в отношении финансовых рисков.
- 17 Оценка результатов деятельности и эффективности использования капитала
- 18 Элементы системы управления финансовыми рисками на предприятии.
- 19 Процедуры управления кредитным риском предприятия.
- 20 Основные процедуры управления риском заимствований (долговым риском)
- 21 Процедуры управления риском ликвидности предприятия.
- 22 Процедуры управления рыночными рисками предприятия вам известны.
- 23 Особенности финансовых рисков банков.
- 24 Нормативное регулирование финансовых рисков в процессе банковского рискменеджмента.
- 25 Применение самострахования в банковском риск-менеджменте.
- 26 Процедуры управления кредитным риском в банке.
- 27 Процедуры управления риском ликвидности в банке.
- 28 Процедуры управления рыночным риском в банке.
- 29 Организационная структура процесса управления финансовыми рисками в
- 30 Специфика финансовых рисков в страховом деле.
- 31 Система финансового риск-менеджмента в страховых организациях.
- 32 Особенности финансового риск-менеджмента профессиональных участников
- 33 Система финансового риск-менеджмента профессиональных участников рынка
- 34 Общая характеристика финансовых рисков государства. Объекты финансового
- 35 Классификация финансовых рисков государства. Управление финансовыми

### **1.2 Темы письменных работ**

Рабочей программой дисциплины не предусмотрено.

### **1.3 Контрольные точки**

Номер контрольной точки	Тип контрольной точки	Способ проведения	Номера тем
1	Индивидуальное задание	с помощью технических средств и информационных систем	1-3
2	Контрольная работа	с помощью технических средств и информационных систем	4-5
3	Текущий контроль	с помощью технических средств и информационных систем	1-6

## 1.4 Другие объекты оценивания

Рабочей программой дисциплины не предусмотрено.

## 1.5 Самостоятельная работа обучающегося

Наименования самостоятельной работы	Номера тем
Выполнение расчетных, аналитических, расчетно-графических и др. заданий	1-5
Работа с аналитическими базами данных, нормативными документами, справочной литературой	2-6
Разработка индивидуальных/ групповых проектов	2-6
Подготовка к экзамену	6

## 1.6 Шкала оценивания результата

Шкалы оценивания и процедуры оценивания результатов обучения **по дисциплине** регламентируются Положением о текущем контроле успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся по программам высшего образования и Положением о балльно-рейтинговой системе.

Для оценки сформированности результатов обучения по дисциплине используется **балльно-рейтинговая система успеваемости обучающихся**:

Формой итогового контроля по дисциплине является экзамен (или дифференцированный зачет), итоговая оценка формируется в соответствии со шкалой, приведенной ниже в таблице:

Баллы	Оценка
≤54	неудовлетворительно
55-69	удовлетворительно
70-84	хорошо

>=85	отлично
------	---------

### Шкала оценивания результата

2 (балл до 54)	Демонстрирует непонимание проблемы. Многие требования, предъявляемые к заданию не выполнены. Демонстрируется первичное восприятие материала. Работа незакончена и /или это плагиат.
3 (балл 55-69)	Демонстрирует частичное понимание проблемы. Большинство требований, предъявляемых, к заданию выполнены. Владение элементами заданного материала. В основном выполненный материал понятен и носит целостный характер.
4 (балл 70-84)	Демонстрирует значительное понимание проблемы обозначенной дисциплиной. Все требования, предъявляемые к заданию выполнены. Содержание выполненных заданий раскрыто и рассмотрено с разных точек зрения.
5 (балл 85-100)	Демонстрирует полное понимание проблемы. Все требования, предъявляемые к заданию выполнены. Продemonстрировано уверенное владение материалом дисциплины. Выполненные задания носят целостных характер, выполнены в полном объеме, структурированы, представлены различные точки зрения, продемонстрирован творческий подход.