МИНОБРНАУКИ РОССИИ

федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«Санкт-Петербургский государственный экономический университет»

|  |  |
| --- | --- |
|  | УТВЕРЖДАЮ  Проректор по образовательной деятельности  \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ В.Г. Шубаева  «\_\_\_\_» \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_20\_\_\_\_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 | *2025* |

Составитель*(и)*:

|  |
| --- |
| к.э.н, Хакимова Галия Ринатовна |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Часов по учебному плану | 144 | **Виды контроля в семестрах:**   |  | | --- | | 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 |  |
| **Итого аудиторных часов** | **32** |
| Самостоятельная работа | 76 |
| Часы на контроль | 36 |
| **Итого академических часов** | **144** |
| **Общая трудоемкость в зачетных единицах** | **4** |

Санкт-Петербург

2025

**СОДЕРЖАНИЕ**

[**1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ** 3](#_Toc83656871)

[**2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ** 3](#_Toc83656872)

[**3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ** 3](#_Toc83656873)

[**4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ\*** 4](#_Toc83656874)

[**5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ** 7](#_Toc83656875)

[**5.1 Рекомендуемая литература** 7](#_Toc83656876)

[**5.2 Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в т.ч. отечественного производства** 7](#_Toc83656877)

[**5.3 Перечень информационных справочных систем (ИСС) и современных профессиональных баз данных (СПБД)** 7](#_Toc83656878)

[**6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ** 8](#_Toc83656879)

[**7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ** 9](#_Toc83656880)

[**8. ОСОБЕННОСТИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ ДЛЯ ИНВАЛИДОВ И ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ** 10](#_Toc83656881)

[**ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ** 12](#_Toc83656882)

[**1.1 Контрольные вопросы и задания к промежуточной аттестации** 12](#_Toc83656883)

[**1.2 Темы письменных работ** 12](#_Toc83656884)

[**1.3 Контрольные точки** 13](#_Toc83656885)

[**1.4 Другие объекты оценивания** 13](#_Toc83656886)

[**1.5 Самостоятельная работа обучающегося** 13](#_Toc83656887)

[**1.6 Шкала оценивания результата** 13](#_Toc83656888)

# **1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ**

|  |  |
| --- | --- |
| **Цель:** | 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 финансовой и инвестиционной деятельности | 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.  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, страновый 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 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). | | 2 | | 1 |  | 12 |
| 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 внутренного 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, марковские процессы, теория очередей и т. д. Модели теории графов и математичекcкой логики: булева алгебра, деревья, автоматные функции. | | 3 | | 4 |  | 12 |
| 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 рисковых 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 |
| **Контроль:** | | | | | | | **36** |
| **Всего по дисциплине:** | | **18** | | **14** | |  | **76** |

\*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: http://znanium.com/catalog/product/394136. | <http://znanium.com/catalog/product/394136.> |
| Батыршин И.З. Нечеткие гибридные системы. Теория и практика [Электронный ресурс]/ И.З. Батыршин [и др.]. – Москва: Физматлит, 2007. – 208 с. – Режим доступа: http://znanium.com/catalog/product/544667. | <http://znanium.com/catalog/product/544667.> |
| Борисов В.В. Нечеткие модели и сети [Электронный ресурс] / В.В.Борисов [и др.]. – Москва: Горячая линия-Телеком, 2012. – 284 с. – Режим доступа: http://znanium.com/catalog/product/367553. | <http://znanium.com/catalog/product/367553.> |
| 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: http://znanium.com/go.php?id=524407 | <http://znanium.com/go.php?id=524407> |

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

|  |
| --- |
| - 7-Zip |
| - ОС Альт образование 10 |
| - LibreOffice Base |
| - LibreOffice Calc |
| - LibreOffice Writer |

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

|  |  |
| --- | --- |
| **№** | **Наименование СПБД/ ИСС** |
| 1. | Электронная библиотека Grebennikon.ru – [www.grebennikon.ru](http://www.grebennikon.ru) |
| 2. | Научная электронная библиотека eLIBRARRY – www.elibrary.ru |
| 3. | Научная электронная библиотека КиберЛеника – www.cyberleninka.ru |
| 4. | База данных ПОЛПРЕД Справочники – [www.polpred.com](http://www.polpred.com) |
| 5. | База данных OECD Books, Papers & Statistics на платформе OECD iLibrary  [www.oecd-ilibrary.org](http://www.oecd-ilibrary.org) |
| 6. | Справочная правовая система КонсультантПлюс (инсталлированный ресурс  СПбГЭУ или www.consultant.ru) |
| 7. | Справочная правовая система «ГАРАНТ» (инсталлированный ресурс СПбГЭУ или www.garant.ru) |
| 8. | Информационно-справочная система «Кодекс» (инсталлированный ресурс  СПбГЭУ или www.kodeks.ru) |
| 9. | Электронная библиотечная система BOOK.ru - www.book.ru |
| 10. | Электронная библиотечная система ЭБС ЮРАЙТ – www.urait.ru |
| 11. | Электронно-библиотечная система ЗНАНИУМ (ZNANIUM) – [www.znanium.com](http://www.znanium.com) |
| 12. | Электронная библиотека СПбГЭУ– opac.unecon.ru |

# **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. 208 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 32 посадочных мест, рабочее место преподавателя, доска меловая 1 шт., парта 10шт., скамейка 10шт., тумба м/мКомпьютер I3-8100/ 8Гб/500Гб/ Philips224E5QSB - 20 шт., Компьютер i5-7400 3 Gh/8Gb/1Tb/Dell e2318h - 1 шт., Мультимедийный проектор 1 NEC ME401X - 1 шт., Экран с электроприводом 153х200 см Matte White - 1 шт., Коммутатор HP ProCurve Switch 2610-24 (24 ports 10/100+2 10/100/1000) - 1 шт. Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий: мультимедийные приложения к лекционным курсам и практическим занятиям, интерактивные учебно-наглядные пособия. | 191002, г. Санкт-Петербург, Кузнечный пер., д. 9/27, лит. А |
| Ауд. 502 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: Моноблок LENOVO ideaCentre A310 (Intel Pentium CPU P6100 @ 2.00GHz/2Gb/250Gb)- 15 шт., Мультимедийный проектор Optoma x 400 - 1 шт., Экран с электроприводом Draper Baronet NTSC (3:4) 213/84 - 1 шт. Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий: мультимедийные приложения к лекционным курсам и практическим занятиям, интерактивные учебно-наглядные пособия. | 191002, г. Санкт-Петербург, Кузнечный пер., д. 9/27, лит. А |
| Ауд. 622 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, рабочее место преподавателя, доска меловая - 1 шт., трибуна - 1 шт., тумба м/м - 1 шт., Моноблок Acer Aspire Z1811 в компл.: i5 2400s/4Gb/1Tб/ - 1 шт., Мультимедийный проектор Тип 1 Optoma x 400 - 1 шт., Экран с электропривод.160х210 см - 1 шт., Акустическая система JBL CONTROL 25 WH - 2 шт., Микшер-усилитель MOBILE 35 - 1 шт. Наборы демонстрационного оборудования и учебно-наглядных пособий: мультимедийные приложения к лекционным курсам и практическим занятиям, интерактивные учебно-наглядные пособия. | 191002, г. Санкт-Петербург, Кузнечный пер., д. 9/27, лит. А |

# **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 | Ситуационная задача | 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 |

## **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.  Продемонстрировано уверенное владение материалом дисциплины. Выполненные задания носят целостных характер, выполнены в полном объеме, структурированы, представлены различные точки зрения, продемонстрирован творческий подход. |