

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:

ФИО: Ашмарина Светлана Игоревна

Должность: Ректор ФГБОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 14.10.2021 09:45:09

Уникальный программный ключ:

59650034d6e3a6baac49b7bd0f8e79fea1433ff3e82f1fc7e9279a031181baba

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт ~~Национальной и мировой экономики~~

Кафедра Мировой экономики

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета
(протокол № 14 от 31 марта 2021 г.)

С ИЗМЕНЕНИЯМИ И ДОПОЛНЕНИЯМИ
(ПРОТОКОЛ №16 от 20 мая 2021 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины

Б1.В.ДВ.11.02 Управление рисками в
международном бизнесе

**Основная профессиональная
образовательная программа**

Направление 38.03.01 Экономика программа
"Мировая экономика"

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Управление рисками в международном бизнесе входит в вариативную часть (дисциплина по выбору) блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Экономика труда, Макроэкономика, Статистика, Экономика природопользования, Налоговая система РФ, Иностранный язык профессионального общения (первый уровень), Иностранный язык (второй), История мировой экономики и международных экономических отношений, Экономика организации, Технологические основы производства, Экология, Теория бухгалтерского учета, Бухгалтерский учет, Маркетинг, Практикум по рынку ценных бумаг, Акционерное дело, Финансы, Рынок ценных бумаг, Финансовые рынки, финансовые институты, Иностранный язык, Внешнеэкономическая деятельность, Деловой иностранный язык, Институциональная экономика, Политология, География зарубежных стран, Деньги, кредит, банки, Мировая экономика и МЭО, Размещение мирового хозяйства, Международные экономические организации, Культурология, Адаптация лиц с ОВЗ

Последующие дисциплины по связям компетенций: Организация и техника внешнеторговых операций, Мировые финансовые рынки

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Управление рисками в международном бизнесе в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-1 - способностью собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-1	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК1з1: основы расчетов экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	ПК1у1: рассчитывать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	ПК1в1: приемами расчетов экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов
	ПК1з2: основы сбора и анализа данных, необходимых для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	ПК1у2: системно анализировать экономические и социально-экономические показатели, делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты	ПК1в2: навыками интерпретации исходных данных для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

ПК-5 - способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-5	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК5з1: методы анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5у1: анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5в1: навыками анализа, интерпретации экономических показателей содержащихся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.
	ПК5з2: способы применения результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., для принятия управленческих решений	ПК5у2: использовать полученные в результате анализа бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. для принятия управленческих решений	ПК5в2: методами принятия управленческих решений по итогам результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.

ПК-7 - способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-7	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
	ПК7з1: основные правила построения аналитического отчета и информационного обзора, методы сбора данных	ПК7у1: организовать сбор информации для информационного обзора и/или аналитического отчета, используя отечественные и зарубежные источники информации	ПК7в1: алгоритмом сбора данных и анализа данных, необходимых для подготовки информационного обзора и/или аналитического отчета
	ПК7з2: методы анализа данных, собранных с применением	ПК7у2: подготовить информационный обзор	ПК7в2: навыками подготовки информационного обзора

	отечественных и зарубежных источников для составления информационного обзора и\или аналитического отчета	и\или аналитический отчет	и\или аналитического отчета
--	--	---------------------------	-----------------------------

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 7
Контактная работа, в том числе:	54.15/1.5
Занятия лекционного типа	18/0.5
Занятия семинарского типа	36/1
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Самостоятельная работа	44.85/1.25
Промежуточная аттестация	9/0.25
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Управление рисками в международном бизнесе представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практич. занятия				
1.	Общие основы риск-менеджмента	10	18			20	ПК1з1, ПК1з2, ПК1у1, ПК1у2, ПК1в1, ПК1в2, ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2, ПК7з1, ПК7з2, ПК7у1, ПК7у2, ПК7в1, ПК7в2
2.	Прикладные аспекты риск-менеджмента	8	18			24,85	ПК1з1, ПК1з2, ПК1у1, ПК1у2, ПК1в1, ПК1в2, ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2,

							ПК7з1, ПК7з2, ПК7у1, ПК7у2, ПК7в1, ПК7в2
	Контроль	9					
	Итого	18	36	0.15		44.85	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Общие основы риск-менеджмента	лекция	Концепции риска и неопределенности.
		лекция	Измерение рисков.
		лекция	Управление рисками.
		лекция	Организационные основы риск-менеджмента
2.	Прикладные аспекты риск-менеджмента	лекция	Валютный риск.
		лекция	Кредитный риск.
		лекция	Риски на рынке акций.
		лекция	Корпоративный риск-менеджмент
		лекция	Банковский риск-менеджмент.

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Общие основы риск-менеджмента	практическое занятие	Концепции риска и неопределенности.
		практическое занятие	Измерение рисков.
		практическое занятие	Управление рисками.
		практическое занятие	Организационные основы риск-менеджмента
2.	Прикладные аспекты риск-менеджмента	практическое занятие	Валютный риск.
		практическое занятие	Кредитный риск.
		практическое занятие	Риски на рынке акций.
		практическое занятие	Корпоративный риск-менеджмент
		практическое занятие	Банковский риск-менеджмент.

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Общие основы риск-менеджмента	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование
2.	Прикладные аспекты риск-менеджмента	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - тестирование

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

Международный бизнес. Теория и практика: учебник для бакалавров / А. И. Погорлецкий [и др.] ; под редакцией А. И. Погорлецкого, С. Ф. Сутырина. — Москва: Издательство Юрайт, 2019. — 733 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-3256-0. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/426103>

Дополнительная литература

Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе: учебник и практикум для вузов / Т. Г. Касьяненко, Г. А. Маховикова. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва: Издательство Юрайт, 2020. — 381 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00375-8. — Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/450126>

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран

	Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

Для проведения занятий лекционного типа используются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в виде презентационных материалов, обеспечивающих тематические иллюстрации.

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Управление рисками в международном бизнесе:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком «+»
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный/письменный опрос	-
	Тестирование	+
	Практические задачи	-
	Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения)	-
Промежуточный контроль	Зачет	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования, утвержденными Ученым советом ФГАОУ ВО СГЭУ №14 от 31.03.2021г.

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-1 - способностью собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)

Пороговый	ПК1з1: основы расчетов экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	ПК1у1: рассчитывать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов	ПК1в1: приемами расчетов экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов
Повышенный	ПК1з2: основы сбора и анализа данных, необходимых для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов	ПК1у2: системно анализировать экономические и социально-экономические показатели, делать выводы и обосновывать полученные конечные результаты	ПК1в2: навыками интерпретации исходных данных для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

ПК-5 - способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК5з1: методы анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5у1: анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.	ПК5в1: навыками анализа, интерпретации экономических показателей содержащихся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.
Повышенный	ПК5з2: способы применения результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., для принятия управленческих решений	ПК5у2: использовать полученные в результате анализа бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. для принятия управленческих решений	ПК5в2: методами принятия управленческих решений по итогам результатов анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д.

ПК-7 - способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
Пороговый	ПК7з1: основные правила построения аналитического отчета и информационного обзора, методы сбора данных	ПК7у1: организовать сбор информации для информационного обзора и/или аналитического отчета, используя отечественные и зарубежные источники информации	ПК7в1: алгоритмом сбора данных и анализа данных, необходимых для подготовки информационного обзора и/или аналитического отчета
Повышенный	ПК7з2: методы анализа данных, собранных с применением отечественных и зарубежных источников для составления информационного обзора и/или аналитического отчета	ПК7у2: подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет	ПК7в2: навыками подготовки информационного обзора и/или аналитического отчета

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный
1.	Общие основы риск-менеджмента	ПК1з1, ПК1з2, ПК1у1, ПК1у2, ПК1в1, ПК1в2, ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2, ПК7з1, ПК7з2, ПК7у1, ПК7у2, ПК7в1, ПК7в2	- оценка докладов - тестирование	Зачет
2.	Прикладные аспекты риск-менеджмента	ПК1з1, ПК1з2, ПК1у1, ПК1у2, ПК1в1, ПК1в2, ПК5з1, ПК5з2, ПК5у1, ПК5у2, ПК5в1, ПК5в2, ПК7з1, ПК7з2, ПК7у1, ПК7у2, ПК7в1, ПК7в2	- оценка докладов - тестирование	Зачет

6.4. Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Общие основы риск-менеджмента	Тема 1. Концепции риска и неопределенности. 1. Риск и неопределенность в книге Ф. Найта «Риск, неопределенность и прибыль».

	<p>2. Субъективные оценки экономических агентов и неопределенность в книге Л. фон Мизеса «Человеческая деятельность».</p> <p>3. Риск, неопределенность и ожидания в книге Дж. М. Кейнса «Общая теория занятости, процента и денег».</p> <p>4. Риск, неопределенность и экономические институты в книге Д. Норта «Понимание процесса экономических изменений».</p> <p>Тема 2. Измерение рисков.</p> <p>5. Риск и доходность: теоретическая концепция Г. Марковица.</p> <p>6. Выбор оптимального портфеля ценных бумаг: реализация решения задачи в Excel.</p> <p>7. Систематический и специфический риск: модель оценки капитальных активов У. Шарпа.</p> <p>8. Критический анализ методологических оснований современной теории финансов в докладе Ю.А. Ольсевича (Институт экономики РАН, 2009 г.).</p>
<p>Прикладные аспекты риск-менеджмента</p>	<p>Тема 1. Валютный риск.</p> <p>9. Валютный риск: определение и измерение.</p> <p>10. Регулирование открытой валютной позиции коммерческих банков в РФ.</p> <p>Тема 2. Кредитный риск.</p> <p>11. Кредитный риск: определение и измерение.</p> <p>12. Кредитные рейтинговые агентства: роль и функции в глобальной финансовой системе.</p> <p>13. Нормативное регулирование кредитного риска коммерческих банков в РФ.</p> <p>Тема 3. Управление рисками.</p> <p>14. Организация современного корпоративного риск-менеджмента. Внутренний контроль и его основные функции.</p> <p>15. Организация современного банковского риск-менеджмента.</p> <p>16. Базель I как стандарт достаточности банковского капитала.</p>

- | | |
|--|---|
| | 17. Базель II как стандарт достаточности банковского капитала.
18. Базель III как стандарт достаточности банковского капитала. |
|--|---|

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций
<https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

Какое событие происходило в период 1929 – 1939 гг.:

- «Великая депрессия»
- «Черный понедельник»
- Первый мировой финансовый кризис

Мировой экономический кризис 2008 года еще называют:

- «Великая депрессия»
- «Великая рецессия»
- «Система Джона Ло»

Причина кризиса 1857 - 1858 гг.:

- спекуляции с акциями железных дорог и последовавший за этим крах американской банковской системы
- стремительный рост рынков недвижимости
- диспропорция между товарной массой и объемом денежных средств

С позиции классической теории можно выделить следующие виды экономических кризисов:

- курсовой, финансовый, валютный, биржевой
- денежно-кредитный, финансовый, валютный, брокерский
- денежно-кредитный, финансовый, валютный, биржевой

Какое событие произошло раньше остальных?

- Нефтяной кризис
- «Длинная депрессия»
- «Великая депрессия»

Причиной кризиса 1998-1999 гг. было:

- острая нехватка средств и огромный государственный долг
- диспропорция между товарной массой и объемом денежных средств
- отток инвесторов с рынков после сильного снижения капитализации нескольких крупных компаний.

Что такое теория валютных кризисов?

- теория кризисов платежного баланса
- теория кризисов валютного баланса
- теория кризисов бухгалтерского баланса

Какие существуют модели валютных кризисов?

- каноническая, модель «второго поколения», модель «третьего поколения»
- модель Кругмана, модель МВФ, модель Чанга
- нет разновидностей

Модель Кругмана – это:

- модель, характеризующаяся множественным равновесием, когда потеря уверенности порождает коллапс
- модель, характеризующаяся множественным равновесием, когда потеря уверенности не порождает коллапс
- модель предпринимательского класса

Под валютным крахом понимается падение номинального курса национальной валюты более чем на:

- 25%
- 30%
- 10%

Операция своп – это...

- право выбора времени поставки или платежа
- срочная валютная операция
- обмен иностранной валюты

Опционный хедж эффективней хеджирования фьючерсами?

- да
- нет
- нет однозначного ответа

Валютная своп – это операция...

- покупки иностранной валюты с немедленной оплатой в национальной валюте
- обмена ценных бумаг
- выкупа ценных бумаг

Спрэд используют:

- дилеры
- брокеры
- инвесторы

От чего зависит величина своп-пунктов по валютным свопам?

- от валютного спот-курса
- от форвардного валютного курса
- от процентных ставок по валютам

Биржа по согласованию с каким центром устанавливает время проведения торгов по каждому из инструментов во Временном регламенте?

- клиринговым
- лизинговым
- международным

Назовите количество организационных структур различных форм собственности, которые входят в состав Московской Биржи?

- 40
- 50
- 30

За какой период до даты введения указанных изменений в действие Биржа извещает Участников торгов обо всех изменениях, касающихся дня и/или времени проведения торгов (в том числе по отдельным инструментам)?

- не ранее пройденных 3 рабочих дней
- не позднее, чем за 5 рабочих дней
- +не позднее, чем за три рабочих дня

Сделки заключаются в соответствии с «Правилами организованных торгов ПАО Московская Биржа на валютном рынке и рынке драгоценных металлов» в режиме...

- двойного встречного аукциона
- тройного встречного аукциона
- простого аукциона

Какой федеральный закон регулирует отношения, возникающие на организованных торгах на товарном и (или) финансовом рынках, устанавливает требования к организаторам и участникам таких торгов, определяет основы государственного регулирования указанной деятельности и контроля за ее осуществлением?

- Федеральный закон «О консолидированной финансовой отчетности»
- Федеральный закон «О национальной платежной системе»
- Федеральный закон "Об организованных торгах"

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Общие основы риск-менеджмента	<ol style="list-style-type: none">1. Риск и неопределенность в книге Ф. Найта «Риск, неопределенность и прибыль».2. Субъективные оценки экономических агентов и неопределенность в книге Л. фон Мизеса «Человеческая деятельность».

	<ol style="list-style-type: none"> 3. Риск, неопределенность и ожидания в книге Дж. М. Кейнса «Общая теория занятости, процента и денег». 4. Риск, неопределенность и экономические институты в книге Д. Норта «Понимание процесса экономических изменений». 5. Риск и доходность: теоретическая концепция Г. Марковица. 6. Выбор оптимального портфеля ценных бумаг: реализация решения задачи в Excel. 7. Систематический и специфический риск: модель оценки капитальных активов У. Шарпа. 8. Критический анализ методологических оснований современной теории финансов по учету риска и неопределенности в докладе Ю.А. Ольсевича (Институт экономики РАН, 2009 г.).
<p>Прикладные аспекты риск-менеджмента</p>	<ol style="list-style-type: none"> 9. Валютный риск: определение и измерение. 10. Регулирование открытой валютной позиции коммерческих банков в РФ. 11. Кредитный риск: определение и измерение. 12. Кредитные рейтинговые агентства: роль и функции в глобальной финансовой системе. 13. Нормативное регулирование кредитного риска коммерческих банков в РФ. 14. Кредитные рейтинговые агентства: роль и функции в глобальной финансовой системе. 15. Риск вложений в акции: определение и измерение. 16. Методика VAR: основные блоки модели. 17. Методика VAR: историческое моделирование и его реализация в Excel. 18. Методика VAR: дельта-нормальный метод и его реализация в Excel. 19. Методика VAR: метод Монте-Карло. 20. Стресс-тестирование. 21. Организация современного корпоративного риск-менеджмента. Внутренний контроль и его основные функции. 22. Организация современного банковского риск-менеджмента. 23. Базель I как стандарт достаточности банковского капитала. 24. Базель II как стандарт достаточности банковского капитала. 25. Базель III как стандарт достаточности банковского капитала.

--	--

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы
«зачтено»	ПК1з1, ПК1у1, ПК1в1, ПК5з1, ПК5у1, ПК5в1, ПК7з1, ПК7у1, ПК7в1
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне