

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 22.07.2024 16:58:10

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

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

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Экономической теории

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 30 мая 2024 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины

Б1.В.10 Международная практика управления
рисками валютных, кредитных и финансовых
операций

**Основная профессиональная
образовательная программа**

38.04.01 Экономика программа Мировая
экономика и международный бизнес

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2024

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 Международная практика управления рисками валютных, кредитных и финансовых операций входит в часть, формируемая участниками образовательных отношений блока Б1.Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Логистическое управление международными цепочками поставок, Таможенное и тарифное регулирование, Электронная коммерция на международных рынках, Цифровая трансформация мировой экономики, Технологические и географические основы мировой транспортной инфраструктуры, Технологические основы размещения мирового хозяйства, Международное финансирование и международные расчеты

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

Изучение дисциплины Международная практика управления рисками валютных, кредитных и финансовых операций в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Универсальные компетенции (УК):

УК-1 - Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
УК-1	УК-1.1: Знать:	УК-1.2: Уметь:	УК-1.3: Владеть (иметь навыки):
	основные методы критического анализа, методологию системного подхода, методы разработки стратегий	принимать конкретные решения для повышения эффективности процедур анализа проблем, принятия решений и разработки стратегий	методами установления причинно-следственных связей и определения наиболее значимых среди них; методиками постановки цели и определения способов ее достижения; методиками разработки стратегий действий при проблемных ситуациях

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - Способен к обобщению и систематизации требований законодательства Российской Федерации и требований международных соглашений и договоров к внешнеэкономической деятельности, способен разрабатывать стратегии внешнеэкономической деятельности, привлечения мер её государственной поддержки

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-2	ПК-2.1: Знать:	ПК-2.2: Уметь:	ПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	нормативные правовые акты, регламентирующие внешнеэкономическую деятельность, международные	обобщать и систематизировать информацию о направлениях деятельности	навыками разработки стратегии внешнеэкономической деятельности, привлечения мер поддержки

	договоры в сфере стандартов и требований к продукции, нормативные правовые акты, регламентирующие государственную поддержку внешнеэкономической деятельности, виды, формы и инструменты государственной поддержки внешнеэкономической деятельности	организации с учетом требований законодательства во внешнеэкономической сфере	
--	--	---	--

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 4
Контактная работа, в том числе:	26.3/0.73
Занятия семинарского типа	24/0.67
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.3/0.01
Групповая контактная работа (ГКР)	2/0.06
Самостоятельная работа:	119.7/3.32
Промежуточная аттестация	34/0.94
Вид промежуточной аттестации:	
Экзамен	Экз
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	180
Зачетные единицы	5

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Международная практика управления рисками валютных, кредитных и финансовых операций 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
		Занятия семинарского типа		ИКР		
		Практич. занятия	ГКР			
1.	Общие основы риск-менеджмента	4	6	0,13	0,83	УК-1.1, УК-1.2, УК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
2.	Прикладные аспекты риск-менеджмента	4	10	0,17	1,17	УК-1.1, УК-1.2, УК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
	Контроль	34				

Итого	24	0.3	2	119.7
-------	----	-----	---	-------

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Общие основы риск-менеджмента Прикладные аспекты риск-менеджмента Прикладные аспекты риск-менеджмента	практическое занятие	Концепции риска и неопределенности.
		практическое занятие	Представления о связи риска и доходности.
		практическое занятие	Методология оптимизации портфеля ценных бумаг.
		практическое занятие	Валютные риски, их виды.
		практическое занятие	Риски международных кредитных и финансовых операций, их виды.
		практическое занятие	Методики риск-менеджмента. Стресс-тестирование.
2.	Общие основы риск-менеджмента Прикладные аспекты риск-менеджмента	практическое занятие	Организация корпоративного и банковского риск-менеджмента.
		практическое занятие	Базельские стандарты как методические рекомендации по повышению качества управления рисками в банковском деле.
		практическое занятие	Концепции риска и неопределенности.
		практическое занятие	Представления о связи риска и доходности.

** 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

1. Международный финансовый рынок : учебник и практикум для вузов / М. А. Эскиндаров

[и др.] ; под общей редакцией М. А. Эскиндарова, Е. А. Звоновой. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 453 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-8904-5. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/512093>

Дополнительная литература

1. Глориозов, А. Г. Внешнеторговое финансирование и гарантийный бизнес : практическое пособие / А. Г. Глориозов, Д. М. Михайлов. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 905 с. — (Профессиональная практика). — ISBN 978-5-534-14513-7. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/510445>

Литература для самостоятельного изучения

1. Хасбулатов, Р. И. Международные финансы в 2 ч. Часть 1. : учебник для вузов / Р. И. Хасбулатов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 408 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-06365-3. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/473919>

2. Хасбулатов, Р. И. Международные финансы в 2 ч. Часть 2. : учебник для вузов / Р. И. Хасбулатов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 332 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-06366-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/473920>.

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный

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. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)

3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)

4. 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

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Международная практика управления рисками валютных, кредитных и финансовых операций:

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	Экзамен	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

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

Универсальные компетенции (УК):

УК-1 - Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	УК-1.1: Знать:	УК-1.2: Уметь:	УК-1.3: Владеть (иметь)

	основные методы критического анализа, методологию системного подхода, методы разработки стратегий	принимать конкретные решения для повышения эффективности процедур анализа проблем, принятия решений и разработки стратегий	навыки): методами установления причинно-следственных связей и определения наиболее значимых среди них; методиками постановки цели и определения способов ее достижения; методиками разработки стратегий действий при проблемных ситуациях
Пороговый	Возможности обработки собранной информации для решения профессиональных задач.	Осуществлять процедуры анализа проблем.	Приемами решения профессиональных задач на основе результатов, полученных в результате анализа и обработки собранной информации.
Стандартный (в дополнение к пороговому)	Способы систематизации разнородных данных, процедур анализа проблем и принятия решений.	Осуществлять эффективные процедуры анализа проблем и принятия решений в профессиональной деятельности.	Навыками анализа и систематизации данных.
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	Методы установления причинно-следственных связей и определения наиболее значимых среди них; методики постановки цели и определения способов ее достижения; методики разработки стратегий действий при проблемных ситуациях.	Анализировать методы установления причинно-следственных связей и определения наиболее значимых среди них; методики постановки цели и определения способов ее достижения; методики разработки стратегий действий при проблемных ситуациях, связанных с валютно-финансовыми рисками.	Приемами выбора методов установления причинно-следственных связей и определения наиболее значимых среди них; методиками постановки цели и определения способов ее достижения; методиками разработки стратегий действий при проблемных ситуациях с учетом существующих валютно-финансовых рисков.

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - Способен к обобщению и систематизации требований законодательства Российской Федерации и требований международных соглашений и договоров к внешнеэкономической деятельности, способен разрабатывать стратегии внешнеэкономической деятельности, привлечения мер её государственной поддержки

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-2.1: Знать: нормативные правовые акты, регламентирующие внешнеэкономическую деятельность,	ПК-2.2: Уметь: обобщать и систематизировать информацию о направлениях	ПК-2.3: Владеть (иметь навыки): навыками разработки стратегии внешнеэкономической деятельности, привлечения

	международные договоры в сфере стандартов и требований к продукции, нормативные правовые акты, регламентирующие государственную поддержку внешнеэкономической деятельности, виды, формы и инструменты государственной поддержки внешнеэкономической деятельности	деятельности организации с учетом требований законодательства во внешнеэкономической сфере	мер поддержки
Пороговый	Основные нормы международного и российского права в сфере внешнеэкономической деятельности.	Анализировать и оценивать нормативно-правовую информацию внешнеэкономического характера, планировать и осуществлять свою деятельность с учётом результатов этого анализа.	Правовыми нормами российского и международного уровней, регулируемыми отношения во внешнеэкономической сфере.
Стандартный (в дополнение к пороговому)	Нормативные правовые акты, регламентирующие внешнеэкономическую деятельность, международные договоры в сфере стандартов и требований к продукции, нормативные правовые акты, регламентирующие государственную поддержку внешнеэкономической деятельности.	Использовать нормативно-правовые акты, регламентирующие внешнеэкономическую деятельность, международные договоры в сфере стандартов и требований к продукции, находя в них и применяя нужные положения, делая обоснованные выводы относительно действий организации, подвергающейся валютно-финансовым рискам.	Навыками по разработке внешнеэкономических стратегий деятельности организации, испытывающей валютные, кредитные и финансовые риски.
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	Виды, формы и инструменты государственной поддержки внешнеэкономической деятельности, возможные действия для ее получения.	Обобщать и систематизировать правовую информацию, относящуюся к направлениям внешнеэкономической деятельности организации, затрагиваемых	Навыками по разработке мероприятий, нацеленных на получение организацией государственной поддержки ее внешнеэкономической деятельности с учетом сопровождающих ее валютно-финансовых

		валютно-финансовыми рисками.	рисков.
--	--	---------------------------------	---------

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	УК-1.1, УК-1.2, УК- 1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3	Тестирование	Экзамен
2.	Прикладные аспекты риск-менеджмента	УК-1.1, УК-1.2, УК- 1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3	Оценка доклада	Экзамен

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Общие основы риск-менеджмента	1. Риск и неопределенность и прибыль в концепции Ф. Найта. 2. Связь субъективных оценок неопределенности и экономических агентов Л. фон Мизесом. 3. Взаимодействие риска, неопределенности и ожиданий у Дж. М. Кейнса. 4. Система риска, неопределенности и экономических институтов в концепции Д. Норта «Понимание процесса экономических изменений» 5. Риск и доходность: теоретическая концепция Г. Марковица. 6. Выбор оптимального портфеля ценных бумаг в Excel. 7. Систематический и специфический риск: модель оценки капитальных активов У. Шарпа. 8. Критический анализ методологических оснований современной теории финансов в работах Ю.А. Ольсевича.
Прикладные аспекты риск-менеджмента	9. Методы измерения валютного риска. Регулирование открытой валютной позиции коммерческих банков. 10. Методы измерения кредитного риска. 11. Роль и функции в глобальной финансовой системе кредитных рейтинговых агентств. 12. Нормативы регулирования кредитного риска российских коммерческих банков. 13. Организация современного корпоративного и банковского риск-менеджмента. 14. Основные функции внутриорганизационного контроля. 15. Эволюция Базельских стандартов достаточности банковского капитала.

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

<https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

1. Какое событие происходило в период 1929 – 1939 гг.:

- а) - «великая депрессия»
- б) - «черный понедельник»
- в) - первый мировой финансовый кризис

2. Мировой экономический кризис 2008 года еще называют:

- а) - «великая депрессия»
- б) - «великая рецессия»
- в) - «система Джона Ло»

3. Причина кризиса 1857 - 1858 гг.:

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

4. С позиции классической теории можно выделить следующие виды экономических кризисов:

- а) - курсовой, финансовый, валютный, биржевой
- б) - денежно-кредитный, финансовый, валютный, брокерский
- в) - денежно-кредитный, финансовый, валютный, биржевой

5. Какое событие произошло раньше остальных?

- а) - нефтяной кризис
- б) - «длинная депрессия»
- в) - «великая депрессия»

6. Причиной кризиса 1998-1999 гг. было:

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

7. Что такое теория валютных кризисов?

- а) - теория кризисов платежного баланса
- б) - теория кризисов валютного баланса
- в) - теория кризисов бухгалтерского баланса

8. Какие существуют модели валютных кризисов?

- а) - каноническая, модель «второго поколения», модель «третьего поколения»
- б) - модель Кругмана, модель МВФ, модель Чанга
- в) - нет разновидностей

9. Модель Кругмана – это:

- а) - модель, характеризующаяся множественным равновесием, когда потеря уверенности порождает коллапс
- б) - модель, характеризующаяся множественным равновесием, когда потеря уверенности не порождает коллапс
- в) - модель предпринимательского класса

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

- а) -25%
- б) -30%
- в) -10%

11. Операция своп – это...

- а) - право выбора времени поставки или платежа
- б) - срочная валютная операция
- в) - обмен иностранной валюты

12. Опционный хедж эффективней хеджирования фьючерсами?

- а) - да

- б) -нет
- в) -нет однозначного ответа

13. Валютная своп – это операция...

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

14. Спрэд используют:

- а) -дилеры
- б) -брокеры
- в) -инвесторы

15. От чего зависит величина своп-пунктов по валютным свопам?

- а) -от валютного спот-курса
- б) -от форвардного валютного курса
- в) -от процентных ставок по валютам

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

- а) -клиринговым
- б) -лизинговым
- в) -международным

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

- а) -40
- б) -50
- в) -30

18. 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)?

- а) - не ранее пройденных 3 рабочих дней
- б) - не позднее, чем за 5 рабочих дней
- в) - не позднее, чем за три рабочих дня

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

- а) -двойного встречного аукциона
- б) -тройного встречного аукциона
- в) -простого аукциона

20. 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?

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

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме экзамена

Раздел дисциплины	Вопросы
Общие основы	1. Риск и неопределенность в книге Ф. Найта «Риск, неопределенность и

риск-менеджмента	<p>прибыль».</p> <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>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 по учету риска и неопределенности по Ю.А. Ольсевичу.</p>
Прикладные аспекты риск-менеджмента	<p>9. Валютный риск: определение и измерение.</p> <p>10. Регулирование открытой валютной позиции коммерческих банков в РФ.</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>14. Риск вложений в акции: определение и измерение.</p> <p>15. Методика VAR: основные блоки модели.</p> <p>16. Методика VAR: историческое моделирование и его реализация в Excel.</p> <p>17. Методика VAR: дельта-нормальный метод и его реализация в Excel.</p> <p>18. Методика VAR: метод Монте-Карло.</p> <p>19. Стресс-тестирование.</p> <p>20. Организация современного корпоративного риск-менеджмента. 21.</p> <p>21. Внутренний контроль и его основные функции.</p> <p>22. Организация современного банковского риск-менеджмента.</p> <p>23. Базель I как стандарт достаточности банковского капитала.</p> <p>24. Базель II как стандарт достаточности банковского капитала.</p> <p>25. Базель III как стандарт достаточности банковского капитала.</p>

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 4-х балльной системы
«отлично»	Повышенный УК-1.1, УК-1.2, УК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
«хорошо»	Стандартный УК-1.1, УК-1.2, УК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
«удовлетворительно»	Пороговый УК-1.1, УК-1.2, УК-1.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
«неудовлетворительно»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне