

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ  
ФЕДЕРАЦИИ  
федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего  
образования  
"САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ  
АЭРОКОСМИЧЕСКОГО ПРИБОРОСТРОЕНИЯ"

Кафедра № 82

УТВЕРЖДАЮ  
Руководитель направления  
проф. д.пед.н. доц.  
(должность, уч. степень, звание)  
А.Г. Степанов  
(подпись)  
«23» июня 2022 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Технологии управления риском»  
(Наименование дисциплины)

Код направления подготовки/ специальности	09.03.03
Наименование направления подготовки/ специальности	Прикладная информатика
Наименование направленности	Прикладная информатика в экономике
Форма обучения	очная

Лист согласования рабочей программы дисциплины

Программу составил (а)

доц. к.э.н.  
(должность, уч. степень, звание)

(подпись, дата)

Е.И. Карасева  
(инициалы, фамилия)

Программа одобрена на заседании кафедры № 82

«16» июня 2022 г, протокол № 11

Заведующий кафедрой № 82

д.э.н., доц.  
(уч. степень, звание)

(подпись, дата)

А.С. Будагов  
(инициалы, фамилия)

Ответственный за ОП ВО 09.03.03(03)

Ст. преподаватель  
(должность, уч. степень, звание)

(подпись, дата)

Н.В. Зуева  
(инициалы, фамилия)

Заместитель директора института №8 по методической работе

доц. к.э.н., доц.  
(должность, уч. степень, звание)

(подпись, дата)

Л.В. Рудакowa  
(инициалы, фамилия)

## Аннотация

Дисциплина «Технологии управления риском» входит в образовательную программу высшего образования – программу бакалавриата по направлению подготовки/специальности 09.03.03 «Прикладная информатика» направленности «Прикладная информатика в экономике». Дисциплина реализуется кафедрой «№82».

Дисциплина нацелена на формирование у выпускника следующих компетенций:

УК-2 «Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений»

ПК-6 «Способность проводить анализ информационных ресурсов и выполнять управленческие действия по результатам анализа»

Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с построением сценариев риска, применения соответствующих методик расчета различных показателей характеризующие риск, использование экспертных оценок и их синтез для показателей, имеющих небольшую статистическую выборку.

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекции, лабораторные работы, практические занятия, самостоятельная работа студента.

Программой дисциплины предусмотрены следующие виды контроля: текущий контроль успеваемости, промежуточная аттестация в форме дифференцированного зачета.

Общая трудоемкость освоения дисциплины составляет 4 зачетных единицы, 144 часа.

Язык обучения по дисциплине «русский»

## 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

### 1.1. Цели преподавания дисциплины

Целью дисциплины является овладение студентами математическими методами получения и обработки исходной информации для качественной и количественной оценки, анализа рисков и управления ими в процессе осуществления экономической деятельности при создания информационных систем., а также предоставление возможности студентам развить и продемонстрировать навыки в области получения и обработки исходной информации для качественной и количественной оценки рисков и управления ими в процессе осуществления экономической деятельности, для выбора рациональных решений в управлении бизнесом

1.2. Дисциплина входит в состав части, формируемой участниками образовательных отношений, образовательной программы высшего образования (далее – ОП ВО).

1.3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения ОП ВО.

В результате изучения дисциплины обучающийся должен обладать следующими компетенциями или их частями. Компетенции и индикаторы их достижения приведены в таблице 1.

Таблица 1 – Перечень компетенций и индикаторов их достижения

Категория (группа) компетенции	Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
Универсальные компетенции	УК-2 Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	УК-2.В.3 владеть навыками использования цифровых средств для решения поставленной задачи
Профессиональные компетенции	ПК-6 Способность проводить анализ информационных ресурсов и выполнять управленческие действия по результатам анализа	ПК-6.3.1 знать методы анализа и обобщения информационных ресурсов ПК-6.У.1 уметь анализировать и обобщать информацию, моделировать (описывать) бизнес-процессы, контролировать и оптимизировать процесс управления, производить оценку процесса управления и выполнение управленческих действий по результатам оценки

## 2. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина может базироваться на знаниях, ранее приобретенных обучающимися при изучении следующих дисциплин:

- «Имитационное моделирование»,
- «Управление инновациями»,

– ...

Знания, полученные при изучении материала данной дисциплины, имеют как самостоятельное значение, так и могут использоваться при изучении других дисциплин:

– «Управленческие решения».

### 3. Объем и трудоемкость дисциплины

Данные об общем объеме дисциплины, трудоемкости отдельных видов учебной работы по дисциплине (и распределение этой трудоемкости по семестрам) представлены в таблице 2.

Таблица 2 – Объем и трудоемкость дисциплины

Вид учебной работы	Всего	Трудоемкость по семестрам
		№7
1	2	3
<b>Общая трудоемкость дисциплины, ЗЕ/ (час)</b>	4/ 144	4/ 144
<b>Из них часов практической подготовки</b>	17	17
<b>Аудиторные занятия, всего час.</b>	51	51
в том числе:		
лекции (Л), (час)	17	17
практические/семинарские занятия (ПЗ), (час)	17	17
лабораторные работы (ЛР), (час)	17	17
курсовой проект (работа) (КП, КР), (час)		
экзамен, (час)		
<b>Самостоятельная работа, всего (час)</b>	93	93
<b>Вид промежуточной аттестации:</b> зачет, дифф. зачет, экзамен (Зачет, Дифф. зач, Экз.**)	Дифф. Зач.	Дифф. Зач.

Примечание: \*\* кандидатский экзамен

### 4. Содержание дисциплины

4.1. Распределение трудоемкости дисциплины по разделам и видам занятий.

Разделы, темы дисциплины и их трудоемкость приведены в таблице 3.

Таблица 3 – Разделы, темы дисциплины, их трудоемкость

Разделы, темы дисциплины	Лекции (час)	ПЗ (СЗ) (час)	ЛР (час)	КП (час)	СРС (час)
<b>Семестр 7</b>					
Раздел 1. Основы управления рисками	3	4			10
Раздел 2. Организационно-методологические аспекты управления риском	7	3			30
Раздел 3 Способы и методы управления рисками	4	3	17		33
Раздел 4 Информационные технологии для оценки рисков.	2	4			10
Раздел 5 Государственное регулирование рисков	1	3			10
Итого в семестре:	17	17	17		93
<b>Итого</b>	17	17	17	0	93

Практическая подготовка заключается в непосредственном выполнении обучающимися определенных трудовых функций, связанных с будущей профессиональной деятельностью.

#### 4.2. Содержание разделов и тем лекционных занятий.

Содержание разделов и тем лекционных занятий приведено в таблице 4.

Таблица 4 – Содержание разделов и тем лекционного цикла

Номер раздела	Название и содержание разделов и тем лекционных занятий
Раздел 1.	Понятие риска. Риск-аппетит. Управления рисками. Риски в окружающем нас мире. Риск и неопределенность. Объективное и субъективное понимание риска. Структурные характеристики риска. Профессиональные организации риск-менеджмента GARP и PRMIA. История становления риск-менеджмента. Классификация рисков. Заинтересованные стороны в управлении риском. Основные стандарты риск-менеджмента. Институты риск-менеджмента.
Раздел 2.	Базель 2 . Общая характеристика рыночных рисков. Валютный риск.. Структура рыночных рисков. Процентный риск. Классификация процентного риска. Фондовый риск. Рынок деривативов. Кредитный риск. Операционные риски. Способы резервирования средств для покрытия возможных убытков. Взаимосвязь операционного, рыночного и кредитного рисков. Правовой риск. Риск деловой репутации.
Раздел 3.	Модель оценки управления рисками. Мотивация как функция риск-менеджмента. Регулирование и его роль в осуществлении риск-менеджмента. Качественные методы: экспертные системы. Метод сводных показателей. Рейтинг и рейтинговые агентства, ключевые индикаторы риска. Количественные методы: Ожидаемая доходность, волатильность , Корелляция, Гистограмма доходов, плотность распределения вероятностей, VaR, Expected Shortfall, Скоринг. GAP-анализ, дюрация, модифицированная дюрация. Дерево решений, логико-вероятностное моделирование, логико-вероятностный анализ..Индикативные модели оценки риска, Ранговые модели оценки риска, Равновесные модели, модели «разброса». Сущность, содержание и виды страхования рисков. Передача риска без страхования
Раздел 4.	Риски информационных технологий. Программные продукты для оценки и анализа риска. FRS FinancialAnalytics (FRS), Risk Weighted Capital (Peoplesoft), RiskPro Credit Risk (IRIS), FlexFinance Basel II (Fernbach) Algo Credit BIS 2 (Algorithmics), Kamakura Risk Manager (Kamakura),Credient (Sungard), SAS Credit Risk Solution (SAS)
Раздел 5.	Благоприятное ведения бизнеса. Страновой риск. Политический риск. Направление государственной поддержки. Уровень развития нормативной базы по управлению рисками. Информационная инфраструктура .Перспективы развития риск-менеджмента.

#### 4.3. Практические (семинарские) занятия

Темы практических занятий и их трудоемкость приведены в таблице 5.

Таблица 5 – Практические занятия и их трудоемкость

№ п/п	Темы практических занятий	Формы практических занятий	Трудоемкость, (час)	Из них практической подготовки, (час)	№ раздела дисциплины
Семестр 7					
1	Построение модели CAPM в EXCEL для российского фондового рынка	Игровое проектирование	2		2
2	Индексный метод торговли на рынке ценных бумаг	Игровое проектирование	2		2
3	Расчет коэффициентов эффективности управления инвестиционным портфелем или торговой стратегией в Excel	Игровое проектирование	3		3
4	Как определить VaR	Игровое проектирование	2		2,3
5	VAR для нескольких активов	Игровое проектирование	2		2,3
6	Расчет показателя Омега для оценки эффективности управления инвестиционного портфеля	Игровое проектирование	2		2,3
7	Проверка знаний студентов	Групповая дискуссия	4		1,2,3,4,5,
Всего			17		

#### 4.4. Лабораторные занятия

Темы лабораторных занятий и их трудоемкость приведены в таблице 6.

Таблица 6 – Лабораторные занятия и их трудоемкость

№ п/п	Наименование лабораторных работ	Трудоемкость, (час)	Из них практической подготовки, (час)	№ раздела дисциплины
Семестр 7				
1	Оценка вероятности событий	2	2	3
2	Оценка вероятностей событий одним экспертом	3	3	3
3	Оценка вероятности событий на основе	4	4	3

	информации от нескольких экспертов			
4	Разработка простого сценария социально-экономического, технического события и его расчет ЛВ- методом	4	4	3
5	Разработка сценария с повторными событиями и его расчет ЛВ- методом	4	4	3
Всего		17	17	

4.5. Курсовое проектирование/ выполнение курсовой работы  
Учебным планом не предусмотрено

4.6. Самостоятельная работа обучающихся  
Виды самостоятельной работы и ее трудоемкость приведены в таблице 7.

Таблица 7 – Виды самостоятельной работы и ее трудоемкость

Вид самостоятельной работы	Всего, час	Семестр 7, час
1	2	3
Изучение теоретического материала дисциплины (ТО)		
Курсовое проектирование (КП, КР)		
Расчетно-графические задания (РГЗ)	70	70
Выполнение реферата (Р)		
Подготовка к текущему контролю успеваемости (ТКУ)	13	13
Домашнее задание (ДЗ)		
Контрольные работы заочников (КРЗ)		
Подготовка к промежуточной аттестации (ПА)	10	10
Всего:	93	93

5. Перечень учебно-методического обеспечения  
для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)  
Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся указаны в п.п. 7-11.

6. Перечень печатных и электронных учебных изданий  
Перечень печатных и электронных учебных изданий приведен в таблице 8.  
Таблица 8– Перечень печатных и электронных учебных изданий

Шифр/ URL адрес	Библиографическая ссылка	Количество экземпляров в библиотеке (кроме электронных экземпляров)
URL: <a href="https://znanium.com">https://znanium.com</a>	Рыхтикова, Н. А. Анализ и управление рисками организации : учеб. пособие / Н.А. Рыхтикова. — 3-е	Электронная библиотека

/catalog/product/991965	изд. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 248 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — <a href="http://www.dx.doi.org/10.12737/textbook_597f03f1c44465.44914120">www.dx.doi.org/10.12737/textbook_597f03f1c44465.44914120</a> . - ISBN 978-5-16-105940-1	«знаниум»
URL: <a href="https://znanium.com/catalog/product/1048725">https://znanium.com/catalog/product/1048725</a>	Тетеревков, И.В. Надежность систем автоматизации : учеб. пособие / И.В. Тетеревков. - Москва ; Вологда : Инфра-Инженерия, 2019. - 356 с. - ISBN 978-5-9729-0308-5. - Текст : электронный	Электронная библиотека «знаниум»
URL: <a href="https://znanium.com/catalog/product/1030572">https://znanium.com/catalog/product/1030572</a>	Трегуб, И. В. Имитационные модели принятия решений : учебное пособие / И.В. Трегуб, Т.А. Горошникова. — Москва : ИНФРА-М, 2020. — 193 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс]. — (Высшее образование: Магистратура). — DOI 10.12737/1030572. - ISBN 978-5-16-107845-7.	Электронная библиотека «знаниум»
005.5 К 21	Карасева, Екатерина Ивановна (канд. экон. наук). Технологии управления риском : учебно-методическое пособие / Е. И. Карасева ; С.-Петерб. гос. ун-т аэрокосм. приборостроения. - Санкт-Петербург : Изд-во ГУАП, 2019. - 93 с. : рис., табл. - Библиогр.: с. 91 - 92 (13 назв.).	5

#### 7. Перечень электронных образовательных ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

Перечень электронных образовательных ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины приведен в таблице 9.

Таблица 9 – Перечень электронных образовательных ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

URL адрес	Наименование
<a href="https://pro.guap.ru/">https://pro.guap.ru/</a>	прогуап
<a href="https://lms.guap.ru/new/">https://lms.guap.ru/new/</a>	лмс

#### 8. Перечень информационных технологий

8.1. Перечень программного обеспечения, используемого при осуществлении образовательного процесса по дисциплине.

Перечень используемого программного обеспечения представлен в таблице 10.

Таблица 10– Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование
	Microsoft Windows 7 110-7 от 28.02.2019
	ПО «Арбитр»
	Microsoft Office Standard 1031-3 от 31.07.2018
	ПО Экспа

8.2. Перечень информационно-справочных систем,используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

Перечень используемых информационно-справочных систем представлен в таблице 11.

Таблица 11– Перечень информационно-справочных систем

№ п/п	Наименование
	Не предусмотрено

#### 9. Материально-техническая база

Состав материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине, представлен в таблице 12.

Таблица 12 – Состав материально-технической базы

№ п/п	Наименование составной части материально-технической базы	Номер аудитории (при необходимости)
1	Мультимедийная лекционная аудитория	
2	Компьютерный класс	Ленс. Ауд.1406-1411(15 комп)

#### 10. Оценочные средства для проведения промежуточной аттестации

10.1. Состав оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине приведен в таблице 13.

Таблица 13 – Состав оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Вид промежуточной аттестации	Перечень оценочных средств
Дифференцированный зачёт	Список вопросов;

10.2. В качестве критериев оценки уровня сформированности (освоения) компетенций обучающимися применяется 5-балльная шкала оценки сформированности компетенций, которая приведена в таблице 14. В течение семестра может использоваться 100-балльная шкала модульно-рейтинговой системы Университета, правила использования которой, установлены соответствующим локальным нормативным актом ГУАП.

Таблица 14 –Критерии оценки уровня сформированности компетенций

Оценка компетенции 5-балльная шкала	Характеристика сформированных компетенций
«отлично» «зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>– обучающийся глубоко и всесторонне усвоил программный материал;</li> <li>– уверенно, логично, последовательно и грамотно его излагает;</li> <li>– опираясь на знания основной и дополнительной литературы, тесно привязывает усвоенные научные положения с практической деятельностью направления;</li> <li>– умело обосновывает и аргументирует выдвигаемые им идеи;</li> <li>– делает выводы и обобщения;</li> <li>– свободно владеет системой специализированных понятий.</li> </ul>
«хорошо» «зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>– обучающийся твердо усвоил программный материал, грамотно и по существу излагает его, опираясь на знания основной литературы;</li> <li>– не допускает существенных неточностей;</li> <li>– увязывает усвоенные знания с практической деятельностью направления;</li> <li>– аргументирует научные положения;</li> </ul>

Оценка компетенции	Характеристика сформированных компетенций
5-балльная шкала	
	<ul style="list-style-type: none"> <li>– делает выводы и обобщения;</li> <li>– владеет системой специализированных понятий.</li> </ul>
«удовлетворительно» «зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>– обучающийся усвоил только основной программный материал, по существу излагает его, опираясь на знания только основной литературы;</li> <li>– допускает несущественные ошибки и неточности;</li> <li>– испытывает затруднения в практическом применении знаний направления;</li> <li>– слабо аргументирует научные положения;</li> <li>– затрудняется в формулировании выводов и обобщений;</li> <li>– частично владеет системой специализированных понятий.</li> </ul>
«неудовлетворительно» «не зачтено»	<ul style="list-style-type: none"> <li>– обучающийся не усвоил значительной части программного материала;</li> <li>– допускает существенные ошибки и неточности при рассмотрении проблем в конкретном направлении;</li> <li>– испытывает трудности в практическом применении знаний;</li> <li>– не может аргументировать научные положения;</li> <li>– не формулирует выводов и обобщений.</li> </ul>

### 10.3. Типовые контрольные задания или иные материалы.

Вопросы (задачи) для экзамена представлены в таблице 15.

Таблица 15 – Вопросы (задачи) для экзамена

№ п/п	Перечень вопросов (задач) для экзамена	Код индикатора
	Учебным планом не предусмотрено	

Вопросы (задачи) для зачета / дифф. зачета представлены в таблице 16.

Таблица 16 – Вопросы (задачи) для зачета / дифф. зачета

№ п/п	Перечень вопросов (задач) для зачета / дифф. зачета	Код индикатора
1	Построить модели САРМ для российского фондового рынка Применить индексный метод торговли на рынке ценных бумаг Рассчитать коэффициенты эффективности управления инвестиционным портфелем Определить VaR актива Определить VaR нескольких активов Рассчитать Омега Построить сценарий риска узла/ ИС Рассчитать вероятность риска логико-вероятностным методом Применить метод сводных показателей для определения вероятности событий.	УК-2.В.3
2	Риски информационных технологий. Программные продукты для оценки и анализа риска Дерево решений, логико-вероятностное моделирование, логико-вероятностный анализ Уровень развития нормативной базы по управлению рисками. Информационная инфраструктура.	ПК-6.3.1

	<p>Перспективы развития риск-менеджмента.</p> <p>Операционные риски. Методы оценки операционных рисков(метод базисного индикатора, стандартизованный метод и усовершенствованные методы)</p> <p>Способы резервирования средств для покрытия возможных убытков. Взаимосвязь операционного, рыночного и кредитного рисков.</p> <p>Правовой риск. Риск деловой репутации.</p> <p>Модель оценки управления рисками.</p> <p>Качественные методы: экспертные системы. Метод сводных показателей.</p> <p>Рейтинг и рейтинговые агентства.</p> <p>Ключевые индикаторы риска.</p> <p>Количественные методы: Ожидаемая доходность, волатильность, Корреляция, Гистограмма доходов, плотность распределения вероятностей</p> <p>Общая характеристика рыночных рисков. Структура рыночных рисков</p> <p>Валютный риск.. Процентный риск. Классификация процентного риска. Фондовый риск.</p> <p>Кредитный риск. Сущность. Методы оценки</p> <p>CRAMM CORAS OCTAVE FRAP методики Microsoft</p>	
3	<p>Применить метод VaR для 1 актива</p> <p>Применить метод VaR для нескольких активов,</p> <p>Построить сценарий атаки, используя логические связи.</p> <p>Построить и проанализировать портфель.</p> <p>Рассчитать доходность актива</p> <p>Применить надстройку анализ данных для прогнозирования будущей цены актива</p> <p>Обобщить статистическую и экспертную информацию методом рандомизированных сводных показателей</p> <p>Построить гистограмму и показать доверительный интервал</p> <p>Рассчитать вероятность атаки/ негативного события логико- вероятностным методом/ методом дерева отказов</p>	ПК-6.У.1

Перечень тем для курсового проектирования/выполнения курсовой работы представлены в таблице 17.

Таблица 17 – Перечень тем для курсового проектирования/выполнения курсовой работы

№ п/п	Примерный перечень тем для курсового проектирования/выполнения курсовой работы
	Учебным планом не предусмотрено

Вопросы для проведения промежуточной аттестации в виде тестирования представлены в таблице 18.

Таблица 18 – Примерный перечень вопросов для тестов

№ п/п	Примерный перечень вопросов для тестов	Код индикатора

Перечень тем контрольных работ по дисциплине обучающихся заочной формы обучения, представлены в таблице 19.

Таблица 19 – Перечень контрольных работ

№ п/п	Перечень контрольных работ
	Не предусмотрено

10.4. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания индикаторов, характеризующих этапы формирования компетенций, содержатся в локальных нормативных актах ГУАП, регламентирующих порядок и процедуру проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся ГУАП.

#### 11. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

11.1. Методические указания для обучающихся по освоению лекционного материала .

Основное назначение лекционного материала – логически стройное, системное, глубокое и ясное изложение учебного материала. Назначение современной лекции в рамках дисциплины не в том, чтобы получить всю информацию по теме, а в освоении фундаментальных проблем дисциплины, методов научного познания, новейших достижений научной мысли. В учебном процессе лекция выполняет методологическую, организационную и информационную функции. Лекция раскрывает понятийный аппарат конкретной области знания, её проблемы, дает цельное представление о дисциплине, показывает взаимосвязь с другими дисциплинами.

Планируемые результаты при освоении обучающимися лекционного материала:

- получение современных, целостных, взаимосвязанных знаний, уровень которых определяется целевой установкой к каждой конкретной теме;
- получение опыта творческой работы совместно с преподавателем;
- развитие профессионально-деловых качеств, любви к предмету и самостоятельного творческого мышления.
- появление необходимого интереса, необходимого для самостоятельной работы;
- получение знаний о современном уровне развития науки и техники и о прогнозе их развития на ближайшие годы;
- научиться методически обрабатывать материал (выделять главные мысли и положения, приходить к конкретным выводам, повторять их в различных формулировках);
- получение точного понимания всех необходимых терминов и понятий.

Лекционный материал может сопровождаться демонстрацией слайдов и использованием раздаточного материала при проведении коротких дискуссий об особенностях применения отдельных тематик по дисциплине.

Структура предоставления лекционного материала:

- Чтение 1 и 2 раздела;
- Опрос по 1 и 2 разделу;
- Чтение 3,4, 5 разделов;
- Опрос 3,4,5 разделов

11.2. Методические указания для обучающихся по прохождению практических занятий .Практическое занятие является одной из основных форм организации учебного процесса, заключающаяся в выполнении обучающимися под руководством преподавателя

комплекса учебных заданий с целью усвоения научно-теоретических основ учебной дисциплины, приобретения умений и навыков, опыта творческой деятельности.

Целью практического занятия для обучающегося является привитие обучающимся умений и навыков практической деятельности по изучаемой дисциплине.

Планируемые результаты при освоении обучающимся практических занятий:

- закрепление, углубление, расширение и детализация знаний при решении конкретных задач;
- развитие познавательных способностей, самостоятельности мышления, творческой активности;
- овладение новыми методами и методиками изучения конкретной учебной дисциплины;
- выработка способности логического осмысления полученных знаний для выполнения заданий;
- обеспечение рационального сочетания коллективной и индивидуальной форм обучения.

#### Требования к проведению практических занятий

Таблица 20 Описание практических занятий

№ п/п	Темы практических занятий	Описание
1	Построение модели CAPM в EXCEL для российского фондового рынка	На основе данных акций компаний рассчитываются требуемые показатели
2	Индексный метод торговли на рынке ценных бумаг	На основе данных акций компаний рассчитываются требуемые показатели
3	Расчет коэффициентов эффективности управления инвестиционным портфелем или торговой стратегией в Excel	На основе данных акций компаний рассчитываются требуемые показатели
4	Как определить VaR	На основе данных акций компаний рассчитываются требуемые показатели
5	VAR для нескольких активов	На основе данных акций компаний рассчитываются требуемые показатели
6	Расчет показателя Омега для оценки эффективности управления инвестиционного портфеля	На основе данных акций компаний рассчитываются требуемые показатели

#### 11.3. Методические указания для обучающихся по выполнению лабораторных работ

В ходе выполнения лабораторных работ обучающийся должен углубить и закрепить знания, практические навыки, овладеть современной методикой и техникой эксперимента в соответствии с квалификационной характеристикой обучающегося. Выполнение лабораторных работ состоит из экспериментально-практической, расчетно-аналитической частей и контрольных мероприятий.

Выполнение лабораторных работ обучающимся является неотъемлемой частью изучения дисциплины, определяемой учебным планом, и относится к средствам, обеспечивающим решение следующих основных задач обучающегося:

- приобретение навыков исследования процессов, явлений и объектов, изучаемых в рамках данной дисциплины;
- закрепление, развитие и детализация теоретических знаний, полученных на лекциях;
- получение новой информации по изучаемой дисциплине;
- приобретение навыков самостоятельной работы с лабораторным оборудованием и приборами.

Задание и требования к проведению лабораторных работ

<https://pro.guap.ru/inside#subjects/2409896>

<https://lms.guap.ru/new/course/view.php?id=3995>

Структура и форма отчета о лабораторной работе

*Обязательно для заполнения преподавателем*  
ГОСТ

<https://pro.guap.ru/inside#subjects/2409896>

<https://lms.guap.ru/new/course/view.php?id=3995>

Требования к оформлению отчета о лабораторной работе  
ГОСТ

<https://pro.guap.ru/inside#subjects/2409896>

<https://lms.guap.ru/new/course/view.php?id=3995>

#### 11.4. Методические указания для обучающихся по прохождению самостоятельной работы

В ходе выполнения самостоятельной работы, обучающийся выполняет работу по заданию и при методическом руководстве преподавателя, но без его непосредственного участия.

Для обучающихся по заочной форме обучения, самостоятельная работа может включать в себя контрольную работу.

В процессе выполнения самостоятельной работы, у обучающегося формируется целесообразное планирование рабочего времени, которое позволяет им развивать умения и навыки в усвоении и систематизации приобретаемых знаний, обеспечивает высокий уровень успеваемости в период обучения, помогает получить навыки повышения профессионального уровня.

Методическими материалами, направляющими самостоятельную работу обучающихся являются:

- учебно-методический материал по дисциплине;
- методические указания по выполнению контрольных работ (для обучающихся по заочной форме обучения).

<a href="https://pro.guap.ru/inside#subjects/2409896">https://pro.guap.ru/inside#subjects/2409896</a>
<a href="https://lms.guap.ru/new/course/view.php?id=3995">https://lms.guap.ru/new/course/view.php?id=3995</a>

#### 11.5. Методические указания для обучающихся по прохождению текущего контроля успеваемости.

Текущий контроль успеваемости предусматривает контроль качества знаний обучающихся, осуществляемого в течение семестра с целью оценивания хода освоения дисциплины.

Студент на текущем контроле должен сдать все практические и лабораторные работы, если этого не сделано, то на дифф зачете он может получить оценку не выше «удовлетворительно».

11.6. Методические указания для обучающихся по прохождению промежуточной аттестации.

Промежуточная аттестация обучающихся предусматривает оценивание промежуточных и окончательных результатов обучения по дисциплине. Она включает в себя:

– дифференцированный зачет – это форма оценки знаний, полученных обучающимся при изучении дисциплины, при выполнении курсовых проектов, курсовых работ, научно-исследовательских работ и прохождении практик с аттестационной оценкой «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно».

Лист внесения изменений в рабочую программу дисциплины

Дата внесения изменений и дополнений. Подпись внесшего изменения	Содержание изменений и дополнений	Дата и № протокола заседания кафедры	Подпись зав. кафедрой