

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
СТАВРОПОЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**

УТВЕРЖДАЮ

Директор/Декан
института экономики, финансов и
управления в АПК
Гуныко Юлия Александровна

«__» _____ 20__ г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ (ОЦЕНОЧНЫХ МАТЕРИАЛОВ)

Б1.В.ДВ.03.02 Статистические методы финансового мониторинга

38.04.01 Экономика

Экономическая безопасность и финансовая разведка

магистр

заочная

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций ОП ВО и овладение следующими результатами обучения по дисциплине:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения	Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине
ПК-1 Способен эксплуатировать интегрированные системы управления рисками	ПК-1.1 Осуществляет мониторинг наиболее критичных рисков, их динамики и динамики ключевых индикаторов риска	<p>знает методы идентификации, оценки и управления рисками и возможности их применения; методы идентификации, оценки и управления рисками и возможности их применения; методики и лучшие практики определения ключевых индикаторов риска; методики, лучшие практики, оценки и исследования предельно допустимого уровня риска; принципы построения карты рисков, ее назначение и методы анализа</p>
		<p>умеет производить периодический мониторинг предельно допустимого уровня риска</p>
		<p>владеет навыками Методикой организации непрерывного мониторинга рисков в соответствии с требованиями стандартов .</p>
ПК-1 Способен эксплуатировать интегрированные системы управления рисками	ПК-1.2 Проводит идентификацию, анализ и оценку наиболее критичных рисков организации	<p>знает внешний и внутренний контекст процесса управления рисками; процесс управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях, а также управления непрерывностью бизнеса; законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками; национальные и международные стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками; стратегии, методы управления рисками и варианты их применения; локальные нормативные акты по управлению рисками в организации; методика выбора варианта или метода воздействия на риск; методы подготовки и внедрения планов воздействия на риск; современные информационные системы и технологии управления рисками и возможности их применения</p>
		<p>умеет анализировать и применять методики оценки и управления рисками; анализировать отчетность по всем видам рисков организации; использовать программное обеспечение для работы с информацией (текстовые, графические, табличные и аналитические приложения, приложения для визуального представления данных) на уровне продвинутого пользователя, работать со специализированными программами по управлению рисками</p>

			<p>владеет навыками оценка эффективности воздействия на риск: выбор варианта или метода воздействия на риск, подготовка и внедрение планов воздействия на риск; идентификация и анализ основных сценариев управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях, а также управление непрерывностью бизнеса;</p>
<p>ПК-1 Способен эксплуатировать интегрированные системы управления рисками</p>	<p>ПК-1.3 Обеспечивает функционирование и развитие системы управления рисками организации</p>	<p>знает типологии отмывания денег; перечень предикатных преступлений в отношении ОД/ФТ; признаки наличия преступления по ОД/ФТ; услуги финансовых посредников, базовые финансовые инструменты; механизм и практика финансирования финансовых операций; формальные и неформальные системы перемещения ценностей и перевода денег; признаки офшорных юрисдикций, финансовые и право-вые инструменты и риски, характерные для данных юрисдикций; законодательство Российской Федерации, регулирующее отношения в сфере ПОД/ФТ</p>	
		<p>умеет определять и использовать источники информации; оценивать источники информации; структурировать информацию; классифицировать информацию</p>	
		<p>владеет навыками проверка полученной информации о возможных фактах ОД/ФТ по результатам выявления в организации операций (сделок), подлежащих контролю в целях ПОД/ФТ; принятие решения о проведении финансового расследования в целях ПОД/ФТ; принятие решения о проведении финансового расследования в целях ПОД/ФТ; Определение источников информации для проведения финансового расследования в целях ПОД/ФТ; разработка плана мероприятий, необходимых для проведения финансового расследования в целях ПОД/ФТ</p>	
<p>ПК-2 Способен проводить финансовые расследования в целях ПОД/ФТ в организации</p>	<p>ПК-2.1 Проверяет полученную информацию о возможных фактах ОД/ФТ и принимает решение о проведении финансового расследования в целях ПОД/ФТ</p>	<p>знает суть бизнес-процессов организации и операций, нехарактерных для обычных операций и сделок; базовые экономические, финансовые принципы, принципы бухгалтерского учета и практика их применения; структура и содержание финансовых отчетов</p>	
		<p>умеет анализировать информацию о подозрительных операциях и сделках; обеспечивать объективность анализа информации; проверять соблюдение всех установленных процедур в рамках используемых методов; осуществлять сбор информации; прогнозировать развитие событий и их последствия</p>	

			<p>владеет навыками сбор дополнительной информации о финансовых операциях и сделках с признаками ОД/ФТ; анализ информации о финансовых операциях и сделках для моделирования подо-зрительной деятельности в целях ПОД/ФТ; сбор информации о возможных фактах ОД/ФТ путем мониторинга средств массовой информации, информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", полученной в рамках сотрудничества участников профессиональных объединений; анализ информации о возможных фактах ОД/ФТ, полученных в результате мониторинга средств массовой информации, информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", а также в рамках сотрудничества участников профессиональных объединений</p>
ПК-2 Способен проводить финансовые расследования в целях ПОД/ФТ в организации	ПК-2.3 Подготавливает отчет о результатах проведенного финансового расследования в целях ПОД/ФТ		<p>знает Нормативные акты Банка России и приказы Росфинмониторинга, регламентирующие порядок и формы представления отчетности (включая порядок заполнения формализованных электронных сообщений через Личный кабинет).</p>
			<p>умеет Систематизировать результаты расследования: группировать собранную информацию по эпизодам, участникам, периодам, видам операций в логической последовательности.</p>
			<p>владеет навыками Методикой составления аналитических отчетов: готовностью подготавливать структурированные, логически выстроенные и доказательные документы.</p>

2. Перечень оценочных средств по дисциплине

№	Наименование раздела/темы	Курс	Код индикаторов достижения компетенций	Оценочное средство проверки результатов достижения индикаторов компетенций
1.	1 раздел. СТАТИСТИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ ФИНАНСОВОГО МОНИТОРИНГА			
1.1.	Финансовый мониторинг	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Устный опрос, Тест
1.2.	Экономические основы ПОД/ФТ/ФРОМУ	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Собеседование
1.3.	Контрольная точка № 1	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Контрольная работа

1.4.	Статистическое наблюдение как метод финансового мониторинга	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Устный опрос, Тест
1.5.	Статистическая группировка как метод финансового мониторинга	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Собеседование
1.6.	Контрольная точка № 2	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Контрольная работа
1.7.	Статистическая сводка как метод финансового мониторинга	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Устный опрос, Тест
1.8.	Меры по противодействию отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Собеседование
1.9.	Контрольная точка №3	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Контрольная работа
1.10.	Промежуточная аттестация	1	ПК-2.1, ПК-2.3, ПК-1.1, ПК-1.2, ПК-1.3	Практико-ориентированные задачи и ситуационные задачи, Разноуровневые задачи и задания
	Промежуточная аттестация			За

3. Оценочные средства (оценочные материалы)

Примерный перечень оценочных средств для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

№ п/п	Наименование оценочного средства	Краткая характеристика оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде (Оценочные материалы)
Текущий контроль			
Для оценки знаний			
1	Собеседование	Средство контроля, организованное как специальная беседа преподавателя с обучающимся на темы, связанные с изучаемой дисциплиной, и рассчитанное на выяснение объема знаний обучающегося по определенному разделу, теме, проблеме и т.п.	Вопросы по темам/разделам дисциплины

2	Устный опрос	Средство контроля знаний студентов, способствующее установлению непосредственного контакта между преподавателем и студентом, в процессе которого преподаватель получает широкие возможности для изучения индивидуальных особенностей усвоения студентами учебного материала.	Перечень вопросов для устного опроса
Для оценки умений			
3	Контрольная работа	Средство проверки умений применять полученные знания для решения задач определенного типа по теме или разделу	Комплект контрольных заданий по вариантам
4	Практико-ориентированные задачи и ситуационные задачи	Задачи направленные на использование приобретенных знаний и умений в практической деятельности и повседневной жизни	Комплект практико-ориентированных и ситуационных задач
Для оценки навыков			
Промежуточная аттестация			
5	Зачет	Средство контроля усвоения учебного материала практических и семинарских занятий, успешного прохождения практик и выполнения в процессе этих практик всех учебных поручений в соответствии с утвержденной программой с выставлением оценки в виде «зачтено», «незачтено».	Перечень вопросов к зачету

4. Примерный фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю) "Статистические методы финансового мониторинга"

Примерные оценочные материалы для текущего контроля успеваемости

Тема 1. Финансовый мониторинг.

1. Финансовый мониторинг: цель, субъекты, объекты.
2. Финансовый мониторинг как вид финансового контроля.
3. Принципы финансового мониторинга.
4. Социально-экономическое и политическое значение финансового мониторинга.

Тема 2. Экономические основы ПОД/ФТ/ФРОМУ.

1. Легализация преступных доходов как фактор негативного воздействия на экономику государства.
2. Причины и условия легализации преступных доходов.
3. История возникновения понятия.
4. Источники возникновения доходов и иного имущества, полученных незаконным путем.
5. Финансирование терроризма: понятие и сущность.
6. Основные формы и источники финансирования, их характерные признаки.
7. Связь финансирования терроризма с отмыванием денег

Тема 3. Статистическое наблюдение как метод финансового мониторинга.

1. Общая характеристика статистического наблюдения.
2. Основные формы статистического наблюдения.
3. Способы сбора информации.
4. Определение объекта, единицы, периода наблюдения.
5. Применение статистического наблюдения в качестве метода финансового мониторинга.

Тема 4. Статистическая группировка как метод финансового мониторинга.

1. Сущность статистической группировки.
2. Виды и типы группировок.
3. Задачи в сфере ПОД/ФТ/ФРОМУ, решаемые с помощью метода группировок.

Тема 5. Статистическая сводка как метод финансового мониторинга.

1. Понятие статистической сводки и её виды.
2. Этапы проведения сводки.
3. Составление программы и плана сводки.
4. Использование статистической сводки в качестве метода финансового мониторинга.

Тема 6. Меры по противодействию отмыванию преступных доходов и финансированию терроризма.

1. Меры, направленные на противодействие легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма(ПОД/ФТ).
2. Использование перечня организаций и физических лиц, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму.
3. Порядок составления перечня и его доведения до сведения организаций, осуществляющих операции с денежными средствами или иным имуществом.

***Примерные оценочные материалы
для проведения промежуточной аттестации (зачет, экзамен)
по итогам освоения дисциплины (модуля)***

Вопросы к зачету

1. Финансовый мониторинг: цель, субъекты, объекты.
2. Финансовый мониторинг как вид финансового контроля.
3. Принципы финансового мониторинга.
4. Социально-экономическое и политическое значение финансового мониторинга.
5. Легализация преступных доходов как фактор негативного воздействия на экономику государства.
6. Причины и условия легализации преступных доходов.
7. История возникновения понятия.
8. Источники возникновения доходов и иного имущества, полученных незаконным путем.
9. Финансирование терроризма: понятие и сущность.
10. Основные формы и источники финансирования, их характерные признаки.
11. Связь финансирования терроризма с отмыванием денег
12. Общая характеристика статистического наблюдения.
13. Основные формы статистического наблюдения.

14. Способы сбора информации.
15. Определение объекта, единицы, периода наблюдения.
16. Применение статистического наблюдения в качестве метода финансового мониторинга.
17. Сущность статистической группировки.
18. Виды и типы группировок.
19. Задачи в сфере ПОД/ФТ/ФРОМУ, решаемые с помощью метода группировок.
20. Понятие статистической сводки и её виды.
21. Этапы проведения сводки.
22. Составление программы и плана сводки.
23. Использование статистической сводки в качестве метода финансового мониторинга.
24. Меры, направленные на противодействие легализации (отмыванию) доходов, полученных преступным путем, и финансированию терроризма(ПОД/ФТ).
25. Использование перечня организаций и физических лиц, в отношении которых имеются сведения об их причастности к экстремистской деятельности или терроризму.
26. Порядок составления перечня и его доведения до сведения организаций, осуществляющих операции с денежными средствами или иным имуществом.

1. Метод научного предвидения, основанный на теоретических закономерностях и причинно-следственных, связях называется:

- а) предвидение;
- б) прогноз;
- в) гипотеза;
- г) предсказание;
- д) предуказание.

2. Необходимость взаимосвязанности и соподчиненности прогнозов объекта прогнозирования и прогнозного фона и их элементов с учетом обратных связей определяет принцип _____ прогнозирования:

- а) согласованности;
- б) системности;
- в) поливариантности;
- г) непрерывности;
- д) адекватности.

3. Обобщение и систематизация информации, построение рядов показателей для выявления тенденций развития объекта прогнозирования и прогнозного фона, разработка моделей и методов их прогнозирования; качественная и количественная оценка сложившихся в прошлом закономерностей осуществляется на этапе:

- а) прогнозной ориентации;
- б) прогнозной ретроспекции;
- в) прогнозного диагноза;
- г) прогнозной проспекции;
- д) верификации прогноза;
- е) корректировки прогноза.

4. _____ информация добывается путем непосредственного наблюдения, регистрации, т.е. прямого сбора и восприятия данных:

- а) Управляющая;
- б) Осведомляющая;
- в) Полезная;
- г) Избыточная;
- д) Ложная;
- е) Семантическая;
- ж) Первичная.

5. Требование, заключающееся в том, что ретроспективная информация должна отражать именно анализируемые стороны деловой деятельности исследуемых объектов в соответствующие моменты времени:

- а) релевантности;
- б) достоверности;

- в) сопоставимости;
- г) репрезентативности;
- д) вариативности;
- е) непрерывности.

6. Преимущества интуитивных методов прогнозирования:

- а) возможность анализа и прогноза развития объекта, не имеющего предыстории;
- б) принципиальная невозможность исключить полностью субъективизм в оценках

экспертов;

- в) возможность прогнозирования качественных (скачкообразных) изменений;
- г) невозможность обеспечить абсолютно объективную оценку компетентности экспертов.

7. Для оценки согласованности мнений экспертов используется метод:

- а) самооценки;
- б) взаимооценки;
- в) Дельфи;
- г) ранговой корреляции;
- д) оценка ранее выполненных прогнозов;
- е) независимой экспертизы;

Типовая практико-ориентированная задача репродуктивного уровня
(оценка умений – max 7 баллов):

На основе имеющейся статистической информации об изменении уровней временного ряда необходимо проверить гипотезу об отсутствии долговременной компоненты (тенденции) на основе критерия Фостера-Стюарта. Доверительная вероятность принимается равной 0,95

t	Y	t	Y	t	Y	t	Y
1	310	6	226	11	487	16	524
2	370	7	700	12	224	17	585
3	360	8	371	13	680	18	347
4	438	9	536	14	437	19	436
5	275	10	366	15	776	20	691

Типовая практико-ориентированная задача реконструктивного уровня
(оценка навыков – max 10 баллов):

По значениям таблично заданной функции найти интерполяционный полином Ньютона наименьшей степени.

x	2	3	4	5
y	56	59	62	76

Оценить значение интерполяционной функции в точке $x = 2,5$.

Темы письменных работ (эссе, рефераты, курсовые работы и др.)

Темы рефератов

1. Финансовый мониторинг: цель, субъекты, объекты.
2. Финансовый мониторинг как вид финансового контроля.
3. Принципы финансового мониторинга.
4. Социально-экономическое и политическое значение финансового мониторинга.
5. Правовые и институциональные основы международного сотрудничества в сфере ПОД/ФТ.
6. Использование инструментов ПОД/ФТ для целей борьбы с организованной преступностью.
7. Обзор международных стандартов по ПОД/ФТ на примере Сорока и Девяти Рекомендаций ФАТФ.
8. Формы надзора и виды проверок Росфинмониторинга