

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Костина Лариса Николаевна
Должность: проректор
Дата подписания: 27.04.2023 17:23
Уникальный программный ключ:
1800f7d89cf4ea7507265ba593fe87537eb15a6c

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
"ДОНЕЦКАЯ АКАДЕМИЯ УПРАВЛЕНИЯ И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ"

Факультет

Финансово-экономический

Кафедра

Финансов

"УТВЕРЖДАЮ"

Проректор

Л.Н. Костина

27.04.2023 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ.01.01

"Управление финансово-экономическими рисками"

Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит
Профиль "Финансы и кредит"

Квалификация	<i>МАГИСТР</i>
Форма обучения	заочная
Общая трудоемкость	108
Год начала подготовки по учебному плану	2023

Донецк
2023

Составитель:

канд. экон. наук, доцент

_____ Е.Ю. Афендикова

Рецензент:

канд. экон. наук, доцент

_____ О.В. Титиевская

Рабочая программа дисциплины (модуля) "Управление финансово-экономическими рисками" разработана в соответствии с:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954)

Рабочая программа дисциплины (модуля) составлена на основании учебного плана Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит

Профиль "Финансы и кредит", утвержденного Ученым советом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС" от 27.04.2023 протокол № 12.

Срок действия программы: 2023-2026

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Финансов
Протокол от 19.04.2023 №11

Заведующий кафедрой:

д-р экон.наук, доцент, Петрушевская В.В.

(подпись)

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году**"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2024 - 2025 учебном году на заседании кафедры Финансов

Протокол от " ____ " _____ 2024 г. №__

Зав. кафедрой д-р экон.наук, доцент, Петрушевская В.В.

(подпись)

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году**"УТВЕРЖДАЮ"**

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2025 - 2026 учебном году на заседании кафедры Финансов

Протокол от " ____ " _____ 2025 г. №__

Зав. кафедрой д-р экон.наук, доцент, Петрушевская В.В.

(подпись)

РАЗДЕЛ 1. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ

1.1. ЦЕЛИ ДИСЦИПЛИНЫ	
Выработки навыков у обучающихся применения основных теоретических основ в области финансовых рисков предприятия, как системы принципов и методов разработки и реализации рискованных финансовых решений, обеспечивающих всестороннюю оценку различных видов финансовых рисков и нейтрализацию их возможных негативных финансовых последствий	
1.2. УЧЕБНЫЕ ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ	
идентификация рисков, присущих различным финансовым операциям; определение концентрации финансовых рисков по направлениям финансовой деятельности; мониторинг факторов внешней среды, по причине которых могут быть не выполнены плановые результаты деятельности.	
1.3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОСНОВНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ	
Цикл (раздел) ОПОП ВО:	Б1.В.ДВ.01.
<i>1.3.1. Дисциплина "Управление финансово-экономическими рисками" опирается на следующие элементы ОПОП ВО:</i>	
Корпоративный риск-менеджмент	
Финансовая эконометрика	
Финансовая безопасность	
<i>1.3.2. Дисциплина "Управление финансово-экономическими рисками" выступает опорой для следующих элементов:</i>	
Преддипломная практика	
1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:	
<i>ПК-3.6: Оценивает эффективность инвестиционных решений предприятия с учетом финансово-экономических рисков.</i>	
Знать:	
Уровень 1	Методики оценивания эффективности инвестиционных решений
Уровень 2	Методики оценивания эффективности инвестиционных решений предприятия
Уровень 3	Методики оценивания эффективности инвестиционных решений предприятия с учетом финансово-экономических рисков
Уметь:	
Уровень 1	Осуществлять оценку эффективности инвестиционных решений
Уровень 2	Осуществлять оценку эффективности инвестиционных решений предприятия
Уровень 3	Осуществлять оценку эффективности инвестиционных решений предприятия с учетом финансово-экономических рисков
Владеть:	
Уровень 1	Методами оценивания эффективности инвестиционных решений
Уровень 2	Методами оценивания эффективности инвестиционных решений предприятия
Уровень 3	Методами оценивания эффективности инвестиционных решений предприятия
1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:	
<i>ПК-4.3: Осуществляет анализ содержания государственных и муниципальных программ, а также других основных видов программно-плановых документов.</i>	
Знать:	
Уровень 1	Методики анализа содержания государственных программ
Уровень 2	Методики анализа содержания муниципальных программ
Уровень 3	Методики анализа содержания муниципальных программ, а также других основных видов программно-плановых документов
Уметь:	
Уровень 1	осуществлять анализ содержания государственных программ

Уровень 2	осуществлять анализ содержания муниципальных программ
Уровень 3	осуществлять анализ содержания муниципальных программ, а также других основных видов программно-плановых документов
Владеть:	
Уровень 1	методами анализа содержания государственных программ
Уровень 2	методами анализа содержания муниципальных программ
Уровень 3	методами анализа содержания муниципальных программ, а также других основных видов программно-плановых документов

В результате освоения дисциплины "Управление финансово-экономическими рисками"

3.1 Знать:	теоретические и практические аспекты экономической сущности экономических рисков, риск-менеджмента как составляющая теории принятия решений
3.2 Уметь:	на основе исследования финансовых процессов и явлений строить стандартные теоретические и практические модели, содержательно интерпретировать полученные результаты в процессе финансового консультирования
3.3 Владеть:	навыками риск-менеджмента в управлении предприятием

1.5. ФОРМЫ КОНТРОЛЯ

Текущий контроль успеваемости позволяет оценить уровень сформированности элементов компетенций (знаний, умений и приобретенных навыков), компетенций с последующим объединением оценок и проводится в форме: устного опроса на лекционных и семинарских/практических занятиях (фронтальный, индивидуальный, комплексный), письменной проверки (тестовые задания, контроль знаний по разделу, ситуационных заданий и т.п.), оценки активности работы обучающегося на занятии, включая задания для самостоятельной работы.

Промежуточная аттестация

Результаты текущего контроля и промежуточной аттестации формируют рейтинговую оценку работы студента. Распределение баллов при формировании рейтинговой оценки работы студента осуществляется в соответствии с действующим локальным нормативным актом. По дисциплине "Управление финансово-экономическими рисками" видом промежуточной аттестации является Зачет с оценкой

РАЗДЕЛ 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

2.1. ТРУДОЕМКОСТЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоёмкость дисциплины "Управление финансово-экономическими рисками" составляет 3 зачётные единицы, 108 часов.

Количество часов, выделяемых на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающегося, определяется учебным планом.

2.2. СОДЕРЖАНИЕ РАЗДЕЛОВ ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Примечание
Раздел 1. Теоретические аспекты финансово-экономических рисков						
Тема 1.1. Экономическая сущность и классификация финансовых рисков /Лек/	3	2	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.4 Л3.5 Л3.6 Л3.7	0	

Тема 1.1. Экономическая сущность и классификация финансовых рисков /Сем зан/	3	2	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л1.1 Л1.1 Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 1.1. Экономическая сущность и классификация финансовых рисков /Ср/	3	7	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л1.1 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 1.2. Количественная оценка риска /Лек/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 1.2. Количественная оценка риска /Сем зан/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 1.2. Количественная оценка риска /Ср/	3	7	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 1.3. Стратегия и тактика управления финансовым риском /Лек/	3	2	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 1.3. Стратегия и тактика управления финансовым риском /Сем зан/	3	2	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 1.3. Стратегия и тактика управления финансовым риском /Ср/	3	7	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 1.4. Факторы, детерминирующие эффективность управления финансовыми рисками /Лек/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	

Тема 1.4. Факторы, детерминирующие эффективность управления финансовыми рисками /Сем зан/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 1.4. Факторы, детерминирующие эффективность управления финансовыми рисками /Ср/	3	8	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Раздел 2. Практические основы управления финансово-экономическими рисками						
Тема 2.1. Управление рисками в производственном комплексе /Лек/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.1. Управление рисками в производственном комплексе /Сем зан/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.1. Управление рисками в производственном комплексе /Ср/	3	8	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.2. Принятие решений в условиях неопределенности риска /Лек/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.2. Принятие решений в условиях неопределенности риска /Сем зан/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.2. Принятие решений в условиях неопределенности риска /Ср/	3	8	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	

Тема 2.3. Способы и методы управления экономическими рисками /Лек/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.3. Способы и методы управления экономическими рисками /Сем зан/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.3. Способы и методы управления экономическими рисками /Ср/	3	8	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.4. Риски невостребованной продукции: внешние, внутренние причины, их анализ /Лек/	3	2	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.4. Риски невостребованной продукции: внешние, внутренние причины, их анализ /Сем зан/	3	2	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 2.4. Риски невостребованной продукции: внешние, внутренние причины, их анализ /Ср/	3	8	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Раздел 3. Теоретические и практические аспекты выбора рискованного решения по критериям						
Тема 3.1. Выбор рискованного решения по критерию Лапласа /Лек/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 3.1. Выбор рискованного решения по критерию Лапласа /Семзан/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	

Тема 3.1. Выбор рискового решения по критерию Лапласа /Ср/	3	8	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 3.2. Выбор рискового решения по критерию Гурвица. Сущность операционно-финансового левириджа /Лек/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 3.2. Выбор рискового решения по критерию Гурвица. Сущность операционно-финансового левириджа /Сем зан/	3	0	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 3.2. Выбор рискового решения по критерию Гурвица. Сущность операционно-финансового левириджа /Ср/	3	8	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 3.2. Выбор рискового решения по критерию Гурвица. Сущность операционно-финансового левириджа /Конс/	3	2	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 3.3. Применения теории экстремальных значений при оценке уровня операционного риска /Лек/	3	2	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 3.3. Применения теории экстремальных значений при оценке уровня операционного риска /Сем зан/	3	7	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	
Тема 3.3. Применения теории экстремальных значений при оценке уровня операционного риска /Ср/	3	4	ПК-3.6 ПК-4.3	Л1.1 Л1.1Л1.1Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.5Л3.4 Л3.6 Л3.7	0	

РАЗДЕЛ 3. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

В процессе освоения дисциплины "Управление финансово-экономическими рисками" используются следующие образовательные технологии: лекции (Л), семинарские занятия (СЗ), самостоятельная работа студентов (СРС) по выполнению различных видов заданий.

В процессе освоения дисциплины "Управление финансово-экономическими рисками" используются следующие интерактивные образовательные технологии: проблемная лекция (ПЛ). Лекционный материал представлен в виде слайд-презентации в формате «PowerPoint». Для наглядности используются справочные материалы, результаты научных исследований т.д. В ходе лекции предусмотрена обратная связь со студентами, активизирующие вопросы. При проведении лекций используется проблемно-ориентированный междисциплинарный подход, предполагающий творческие вопросы и создание дискуссионных ситуаций. При изложении теоретического материала используются такие методы, как: монологический, показательный, диалогический, эвристический, исследовательский, проблемное изложение, а также следующие принципы дидактики высшей школы, такие как: последовательность и систематичность обучения, доступность обучения, принцип научности, принципы взаимосвязи теории и практики, наглядности и др. В конце каждой лекции предусмотрено время для ответов на проблемные вопросы.

Самостоятельная работа предназначена для внеаудиторной работы студентов, связанной с конспектированием источников, учебного материала, изучением дополнительной литературы по дисциплине, подготовкой к текущему контролю, а также выполнением индивидуального задания в форме реферата.

РАЗДЕЛ 4. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

4.1. Рекомендуемая литература			
1. Основная литература			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Хоминич И. П. [и др.]	Управление финансовыми рисками. Практикум: учебное пособие для вузов (129 с.)	Москва : Издательство Юрайт, 2021
Л1.2	Денисова Т. В.	Управление финансовыми рисками : учебное пособие	Ульяновск : УлГТУ, 2021
2. Дополнительная литература			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Петрушевская В. В.	Методологические и организационные процессы формирования финансовой системы: коллективная монография (506 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2020
Л2.2	Волощенко, Л. М.	Совершенствование теоретических основ финансового управления экономикой : коллективная монография (356 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2020
Л2.3	Крамаренко, В. И., Твердохлебов, Н. И	Страновые риски во внешнеэкономической деятельности : учебное пособие (252 с)	Симферополь : ДИАЙПИ, 2020
Л2.4	Таскаева, Н. Н., Прохорова, Ю. С..	Антикризисное управление и риск-менеджмент: учебно-методическое пособие (47 с.)	Москва : МИСИ-МГСУ, ЭБС АСВ, 2020
Л2.5	Барбаумов, В. Е., Рогов, М. А., Щукин, Д. Ф.	Энциклопедия финансового риск-менеджмента: учебное пособие (932 с.)	Москва : Альпина Бизнес Букс, 2020

3. Методические разработки			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
ЛЗ.1	Кириенко О.Э	Банковские риски : методические рекомендации по освоению дисциплины для студентов 4 курса образовательного уровня «бакалавр» направления подготовки 38.03.01 «Экономика» (профили «Банковское дело», «Налоги и налогообложение») очной / заочной форм обучения (60 с.)	Донецк : ДонАУиГС, 2020
ЛЗ.2	Ярембаш А. И.	Управление рисками : конспект лекций для студентов 2 курса ОУ «магистр» направления подготовки 38.04.04 «Государственное и муниципальное управление» (магистерские программы : «Инновационный и проектный менеджмент», «Управление проектами») очной / заочной форм обучения (132 с.)	Донецк : ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2020
ЛЗ.3	Афендикова Е.Ю.	Управление финансово–экономическими рисками: конспект лекций для студентов 2 курса направления подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит», ОУ «магистр» очной / заочной форм обучения (105 с.)	Донецк :ФГБОУ ВО«ДОНАУИГС», 2023
ЛЗ.4	Афендикова Е.Ю.	Управление финансово–экономическими рисками : конспект лекций для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа «Финансы и кредит») очной формы обучения (228 с.)	Донецк :ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС», 2023
ЛЗ.5	Афендикова Е.Ю.	Управление финансово–экономическими рисками: методические рекомендации для проведения семинарских занятий для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа «Финансы и кредит»)	Донецк :ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС», 2023
ЛЗ.6	Афендикова Е.Ю.	Управление финансово–экономическими рисками: методические рекомендации по организации самостоятельной работы для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа «Финансы и кредит»)	Донецк :ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС», 2023
ЛЗ.7	Афендикова Е.Ю.	Управление финансово–экономическими рисками: методические рекомендации по выполнению индивидуального задания для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа «Финансы и кредит»)	Донецк :ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС», 2023

4.3. Перечень программного обеспечения

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства:

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства:

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства:

Microsoft OFFICE 2007 № лицензии 08.07.2008 № 44250460

Microsoft WINDOWS 7 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на копье ПК) Windows 8.1 Professional x86/64 (академическая подписка DreamSpark Premium), LibreOffice 4.3.2.2 (лицензия GNU LGPL v3+ и MPL2.0)

Google Chrome, Mozilla

4.4. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Moodle,

Программное обеспечение «Рабочие программы дисциплин» в составе программного комплекса «ПЛАНЫ» версии 4.42.

Электронный каталог изданий ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС» - <http://unilib.dsum.internal/>

Научная электронная библиотека «КИБЕРЛЕНИНКА» - <https://cyberleninka.ru/>

Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU - <http://elibrary.ru/defaultx.asp>

Электронная библиотека Института проблем рынка РАН Российской академии наук (ИПР РАН) – <http://www.ipr-ras.ru/libr.htm>

Электронная библиотека федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования «Воронежский государственный университет» <https://lib.vsu.ru/>

Электронная библиотека федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования "Уральский государственный экономический университет" <https://www.usue.ru/studentam/biblioteka/>

4.5. Материально-техническое обеспечение дисциплины

1. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа: аудитория № 321 учебный корпус № 6 г. Донецк, ул. Артема, 94 (ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС»):

- комплект мультимедийного оборудования: ноутбук, мультимедийный проектор, экран;
- специализированная мебель: рабочее место преподавателя, рабочие места обучающихся (10), стационарная доска, выкатная доска, Windows 8.1 Professional x86/64 (академическая подписка DreamSpark Premium), LibreOffice 4.3.2.2 (лицензия GNU LGPL v3+ и MPL2.0).

аудитория №809 учебный корпус №1 г. Донецк, ул. Челюскинцев, 163а (ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС»):

- специализированная мебель: рабочее место преподавателя, рабочие места обучающихся (68), стационарная доска, выкатная доска, Windows 8.1 Professional x86/64 (академическая подписка DreamSpark Premium), LibreOffice 4.3.2.2 (лицензия GNU LGPL v3+ и MPL2.0).

2. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, текущего контроля, групповых консультаций и промежуточной аттестации: аудитория №412 учебный корпус №3 г. Донецк, ул. Челюскинцев, 157 (ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС»):

- специализированная мебель: рабочее место преподавателя, рабочие места обучающихся (42), стационарная доска, демонстрационные плакаты.

3. Помещения для самостоятельной работы с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно образовательную среду организации:

читальные залы, учебные корпуса №1 г. Донецк, ул. Челюскинцев, 163а (ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС»), №6 г. Донецк, ул. Артема, 94 (ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС»).

Компьютерная техника с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду (ЭИОС ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС») и электронно-библиотечную систему (ЭБС IPRbooks), а также возможностью индивидуального неограниченного доступа обучающихся в ЭБС и ЭИОС посредством Wi-Fi с персональных мобильных устройств.

Сервер: AMDFX 8320/32Gb(4x8Gb)/4Tb(2x2Tb). На сервере установлена свободно распространяемая операционная система DEBIAN 10. MSWindows 8.1 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК), MSWindowsXP (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК), MSWindows 7 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК), MSOffice 2007 RussianOLPNLAE (лицензии Microsoft № 42638778, № 44250460), MSOffice 2010 Russian (лицензии Microsoft № 47556582, № 49048130), MSOffice 2013 Russian (лицензии Microsoft № 61536955, № 62509303, № 61787009, № 63397364), GrubloaderforALTLinux (лицензия GNU GPLv3), MozillaFirefox (лицензия MPL2.0), Moodle (ModularObject-OrientedDynamicLearningEnvironment, лицензия GNU GPL), IncScape (лицензия GPL 3.0+), PhotoScape (лицензия GNU GPL), 1С ERP УП, 1С ЗУП (бесплатные облачные решения для образовательных учреждений от 1Сfresh.com), OnlyOffice 10.0.1 (SaaS, GNU Affero General Public License3).

РАЗДЕЛ 5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

5.1. Контрольные вопросы и задания

Вопросы к зачету:

1. Финансовые риски. Виды и сущность.
2. Структурные характеристики финансового риска.
3. Особенности классификации рисков.
4. Классификация финансовых рисков по размеру или тяжести ущерба.
5. Управление финансовым риском.
6. Основные принципы управления финансовыми рисками.
7. Управление финансовыми рисками в структуре общего финансового менеджмента.
8. Основные системы управления финансовым риском.
9. Этапы идентификации и анализа рисков.
10. Концепция рискового капитала.
11. Методы уклонения от риска.
12. Методы сокращения риска.
13. Методы передачи риска.
14. Методы покрытия убытка на основе страхования.
15. Страхование коммерческих рисков.
16. Страхование биржевых и валютных рисков.
17. Экономическая теория страховых резервов.
18. Цели и оптимальные решения в страховании.
19. Риск – анализ основных видов предпринимательской деятельности.
20. Общая характеристика основных функций риска.
21. Общая характеристика внешней среды предпринимательства.
22. Эволюция взглядов на категорию «риск» и «неопределенность».
23. Риск и неопределенность: информационный и оценочный подход.
24. Факторы, определяющие представление о риске, варианты оценок предпринимательского риска.
25. Объективное и субъективное понимание финансового риска.
26. Объект и категории субъектов финансового риска.
27. Риск как экономическая категория. Модель реализации риска в бизнесе.
28. Классификация рисков на основе их структурных характеристик.
29. Специфические классификации рисков: финансовые, банковские и страховые риски.
30. Развитие взглядов на управление риском.
31. Понятие и свойства системы управления финансовыми рисками.
32. Цели, задачи и основные этапы управления финансовыми рисками.
33. Концепция приемлемого риска.

34. Диверсификация как метод снижения финансового риска.
35. Современные тенденции в выборе стратегий риск-менеджмента: статическая и динамическая концепция.
36. Качественные методы идентификации и анализа финансовых рисков.
37. Характеристика статистических методов анализа рисков.
38. Характеристика аналитических методов анализа рисков.
39. Биржевые риски: структура, определение уровня, критерии оценки.
40. Методы анализа процентных и кредитных рисков.
41. Инфляционный (дефляционный) риск и его влияние на предпринимательскую деятельность.
- Дисконтирование и риск.
42. Страхование транспортных и имущественных рисков.
43. Инвестиционная стратегия и риск.
44. Методы и технологии идентификации финансовых рисков.

5.2. Темы письменных работ

Темы рефератов:

1. Способы управления рисками на предприятиях реального сектора экономики (диверсификация, самострахование (резервирование), страхование, хеджирование)
2. Интегральные меры риска (назначение, меры риска EaR (Earnings at Risk — риск дохода), CFaR (Cash Flow at Risk — риск потока наличности), EPSaR (Earnings per Share at Risk — риск дохода в расчете на одну акцию) и др.)
3. Основные методы оценки рисков (анализ чувствительности, анализ сценариев, анализ причинно-следственных связей, метод Монте-Карло, метод экспертных оценок)
4. Анализ воздействия внешних и внутренних факторов на риски предприятия
5. Управление рыночными рисками
6. Управление операционными рисками
7. Управление производственными рисками
8. Риск-менеджмент на уровне предприятия
9. Способ расчета показателя потенциальных потерь (VaR — Value at Risk) портфеля
10. Методы расчета VaR: ковариационный (дельта-нормальный), метод исторического моделирования и метод Монте-Карло
11. Управление рисками ликвидности
12. Показатели экономического эффекта и эффективности с учетом риска: EVA (Economic Value Added — экономическая добавленная стоимость), RAROC (Risk Adjusted Return on Capital — скорректированная на риск рентабельность капитала)
13. Общие принципы и специфика управления рисками предприятия
14. Карта рисков — эффективный инструмент управления рисками
15. Анализ инвестиционных рисков методом «дерева решений»
16. Анализ инвестиционных рисков методами имитационного моделирования
17. Модели прогнозирования финансовой несостоятельности предприятия
18. Страхование риска
19. Интегрированный риск-менеджмент на уровне предприятия (ERM (Enterprise Risk Management — комплексная система управления рисками на предприятии))
20. Концепция рисковости стоимости {VaR}
21. Зарубежная практика риск-менеджмента
22. Математические методы рискованного моделирования
23. Методы оценки привлекательности инвестиционного проекта

5.3. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств дисциплины "Управление финансово-экономическими рисками" разработан в соответствии с локальным нормативным актом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС".

Фонд оценочных средств дисциплины "Управление финансово-экономическими рисками" в полном объеме представлен в виде приложения к данному РПД.

5.4. Перечень видов оценочных средств

Устный опрос, решение ситуационных задач, доклад, индивидуальное задание - разноуровневые задания, контроль знаний по разделу, научная составляющая - научные тезисы.

РАЗДЕЛ 6. СРЕДСТВА АДАПТАЦИИ ПРЕПОДАВАНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ К ПОТРЕБНОСТЯМ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ

В случае необходимости, обучающимся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья (по заявлению обучающегося) могут предлагаться одни из следующих вариантов восприятия информации с

учетом их индивидуальных психофизических особенностей:

- 1) с применением электронного обучения и дистанционных технологий.
- 2) с применением специального оборудования (техники) и программного обеспечения, имеющихся в ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС".

В процессе обучения при необходимости для лиц с нарушениями зрения, слуха и опорно-двигательного аппарата предоставляются следующие условия:

- для лиц с нарушениями зрения: учебно-методические материалы в печатной форме увеличенным шрифтом; в форме электронного документа; в форме аудиофайла (перевод учебных материалов в аудиоформат); индивидуальные задания и консультации.
- для лиц с нарушениями слуха: учебно-методические материалы в печатной форме; в форме электронного документа; видеоматериалы с субтитрами; индивидуальные консультации с привлечением сурдопереводчика; индивидуальные задания и консультации.
- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата: учебно-методические материалы в печатной форме; в форме электронного документа; в форме аудиофайла; индивидуальные задания и консультации.

РАЗДЕЛ 7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО УСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Обучающемуся рекомендуется не ограничиваться при изучении темы только основной литературой, необходимо конспектировать лекции, изучать методические рекомендации, издаваемые кафедрой. Для улучшения качества освоения материала необходимо в день лекции повторно изучить сделанный на занятиях конспект, повторить новые понятия, составить структурно-логическую схему лекции. Усвоение дисциплины требует освоения теоретических основ управления финансовыми активами, самостоятельного решения задач на семинарских занятиях, выполнения заданий.

При возникновении сложностей по усвоению программного материала необходимо посещать консультации по дисциплине, задавать уточняющие вопросы на лекциях и семинарских занятиях, а также выполнять дополнительно тренировочные задания.