

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ ДОНЕЦКОЙ НАРОДНОЙ РЕСПУБЛИКИ  
ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ  
ВЫСШЕГО ПРОФЕССИОНАЛЬНОГО ОБРАЗОВАНИЯ  
"ДОНЕЦКАЯ АКАДЕМИЯ УПРАВЛЕНИЯ И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ  
ПРИ ГЛАВЕ ДОНЕЦКОЙ НАРОДНОЙ РЕСПУБЛИКИ"

Факультет Финансово-экономический  
Кафедра Финансов



**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА  
УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**

Б1.В.11


"Корпоративный риск-менеджмент"

Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит  
Магистерская программа "Финансы и кредит"


Квалификация	<i>МАГИСТР</i>
Форма обучения	<i>очная</i>
Общая трудоемкость	<i>4 ЗЕТ</i>
Год начала подготовки по учебному плану	<i>2021</i>

Донецк  
2021

Составитель(и):  
канд. экон. наук, доцент

  
Е.Ю. Афондикова

Рецензент(ы):  
канд. экон. наук, доцент

  
О.В. Титиевская

Рабочая программа дисциплины "Корпоративный риск-менеджмент" разработана в соответствии с:

Государственным образовательным стандартом высшего профессионального образования по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (квалификация "магистр") (приказ Министерства образования и науки ДНР от 04.05.2020 г. №60-НП);

Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 991).


Рабочая программа дисциплины составлена на основании учебного плана:  
Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит

Магистерская программа "Финансы и кредит", утвержденного Ученым советом ГОУ ВПО "ДОНАУИГС" от 26.08.2021 протокол № 1/4.

Срок действия программы: 2021-2023

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Финансов  
Протокол от 26.08.2021 № 1

Заведующий кафедрой:  
д-р экон. наук, доцент Петрушевская В.В.

  
(подпись)

Одобрено Предметно-методической комиссией  
кафедры финансов

Протокол от 26.08.2021 № 1

Председатель ПМК:  
канд. экон. наук, доцент  
Титиевская О.В.

  
(подпись)

---

---

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

Председатель ПМК \_\_\_\_\_ (подпись)

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2022 г. №\_\_

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2022 - 2023 учебном году на заседании кафедры Финансов

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2022 г. №\_\_

Зав. кафедрой Петрушевская В.В. \_\_\_\_\_ (подпись)

---

---

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

Председатель ПМК \_\_\_\_\_ (подпись)

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2023 г. №\_\_

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2023 - 2024 учебном году на заседании кафедры Финансов

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2023 г. №\_\_

Зав. кафедрой Петрушевская В.В. \_\_\_\_\_ (подпись)

---

---

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

Председатель ПМК \_\_\_\_\_ (подпись)

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2024 г. №\_\_

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

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2024 г. №\_\_

Зав. кафедрой Петрушевская В.В. \_\_\_\_\_ (подпись)

---

---

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

Председатель ПМК \_\_\_\_\_ (подпись)

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2025 г. №\_\_

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

Протокол от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 2025 г. №\_\_

Зав. кафедрой Петрушевская В.В. \_\_\_\_\_ (подпись)

## РАЗДЕЛ 1. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ

<b>1.1. ЦЕЛИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
Приобретение обучающимися знаний и умений в области управления корпоративными рисками.	
<b>1.2. УЧЕБНЫЕ ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
<p>формирование комплекса теоретических знаний необходимых для разработки корпоративных систем интегрированного управления рисками компаний, направленных на увеличение их стоимости;</p> <p>приобретение навыков разработки, обоснования и принятия корпоративных стратегий по управлению стоимостью компании в условиях риска и неопределенностей;</p> <p>формирование способности принимать эффективнее решения по разработке интегрированных систем управления рисками на основе системного подхода;</p> <p>приобретение практических навыков диагностирования и картографирования релевантных рисков и техники их анализа;</p> <p>комплексных знаний в области качественного и количественного анализа корпоративных рисков с использованием инструментария CorporateRisk;</p> <p>приобретение способности разрабатывать стратегии элиминирования рисков и корпоративных страховых программ;</p> <p>формирование представлений о разработке и функционировании корпоративных систем интегрированного управления рисками на основе международных регламентов Enterprise-Wide-Risk-Management (EWRM).</p>	
<b>1.3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОСНОВНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ</b>	
Цикл (раздел) ОПОП ВО:	Б1.В
<i>1.3.1. Дисциплина "Корпоративный риск-менеджмент" опирается на следующие элементы ОПОП ВО:</i>	
Финансовый анализ (продвинутый уровень)	
Актуальные проблемы финансов	
Стратегии и современная модель управления в сфере денежно-кредитных отношений	
<i>1.3.2. Дисциплина "Корпоративный риск-менеджмент" выступает опорой для следующих элементов:</i>	
Финансирование инноваций	
Финансовые и денежно-кредитные методы регулирования экономики	
<b>1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:</b>	
<i>ПК-6: Способен к построению интегрированной системы управления рисками</i>	
Знать:	
<b>Уровень 1</b>	Методические основы корпоративного риск-менеджмента
<b>Уровень 2</b>	Элементы процесса интегрированного управления рисками корпораций
<b>Уровень 3</b>	Показатели, которые используются при диагностики и анализе рисков корпораций
Уметь:	
<b>Уровень 1</b>	Проводить качественную и детальную диагностику факторов, которые влияют на возникновение корпоративных рисков
<b>Уровень 2</b>	Разрабатывать управленческие решения, которые направлены на выборе альтернатив и вариантов минимизации корпоративных рисков
<b>Уровень 3</b>	Уметь определять и прогнозировать потери или преимущества от возникновения различных корпоративных рисков ситуаций
Владеть:	
<b>Уровень 1</b>	Навыками проведения необходимого анализа оценки корпоративных рисков
<b>Уровень 2</b>	Сопоставлять результаты оценки по направлениям, которые связаны с минимизацией рисков ситуаций с их негативным влиянием на рассматриваемый объект
<b>Уровень 3</b>	Навыками анализа страновых рисков и факторов, которые на них влияют
<i>В результате освоения дисциплины "Корпоративный риск-менеджмент" обучающийся</i>	
<b>3.1</b>	<b>Знать:</b>
	Основные показатели, характеризующие уровень риска корпоративных структур; методы сбора информации, необходимой для их расчета.

<b>3.2</b>	<b>Уметь:</b>
	Применять знания в области анализа рисков, формирования подходов и выбора методов управления рисками при оценке предлагаемых вариантов управленческих решений и обосновании предложений по их совершенствованию.
<b>3.3</b>	<b>Владеть:</b>
	Методами оценки и анализа основных показателей, характеризующих уровень риска деятельности корпоративных структур и методами управления рисками.
<b>1.5. ФОРМЫ КОНТРОЛЯ</b>	
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 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.	
<b>Промежуточная аттестация</b>	
Результаты текущего контроля и промежуточной аттестации формируют рейтинговую оценку работы студента. Распределение баллов при формировании рейтинговой оценки работы студента осуществляется в соответствии с действующим "Порядок организации текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации в ГОУ ВПО "ДОНАУИГС". По дисциплине "Корпоративный риск-менеджмент" видом промежуточной аттестации является Экзамен	

## РАЗДЕЛ 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

<b>2.1. ТРУДОЕМКОСТЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ</b>						
Общая трудоёмкость дисциплины "Корпоративный риск-менеджмент" составляет 4 зачётные единицы, 144 часов.						
Количество часов, выделяемых на контактную работу с преподавателем и самостоятельную работу обучающегося, определяется учебным планом.						
<b>2.2. СОДЕРЖАНИЕ РАЗДЕЛОВ ДИСЦИПЛИНЫ</b>						
Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте ракт.	Примечание
<b>Раздел 1. Концептуальные основы корпоративного риск-менеджмента</b>						
Тема 1.1. Финансовые риски как экономическая категория: сущность, критерии классификации, методы оценки /Лек/	3	4	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 1.1. Финансовые риски как экономическая категория: сущность, критерии классификации, методы оценки /Сем зан/	3	6	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 1.1. Финансовые риски как экономическая категория: сущность,	3	10	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4	0	

критерии классификации, методы оценки /Ср/				Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4		
Тема 1.2.Риск-менеджмент в банковском сегменте финансовых рисков /Лек/	3	2	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 1.2.Риск-менеджмент в банковском сегменте финансовых рисков /Сем зан/	3	6	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 1.2.Риск-менеджмент в банковском сегменте финансовых рисков /Ср/	3	8	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э2 Э3 Э4	0	
<b>Раздел 2. Способы управления банковскими и страховыми рисками</b>						
Тема 2.1.Способы минимизации банковских рисков /Лек/	3	4	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 2.1.Способы минимизации банковских рисков /Сем зан/	3	6	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 2.1.Способы минимизации банковских рисков /Ср/	3	8	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.2.Управление рисками,	3	2	ПК-6	Л1.1 Л1.2	0	

возникающими в страховом бизнесе /Лек/				Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3		
Тема 2.2.Управление рисками, возникающими в страховом бизнесе /Сем зан/	3	6	ПК-6	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.2.Управление рисками, возникающими в страховом бизнесе /Ср/	3	7	ПК-6	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Э1 Э2 Э3	0	
<b>Раздел 3. Инновационные инструменты риск-менеджмента</b>						
Тема 3.1.Механизм управления рисками, связанными со страховой деятельностью /Лек/	3	2	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 3.1.Механизм управления рисками, связанными со страховой деятельностью /Сем зан/	3	6	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 3.1.Механизм управления рисками, связанными со страховой деятельностью /Ср/	3	8	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 3.2.Секьюритизация страховых активов как инструмент управления инвестиционными рисками страховщика /Лек/	3	2	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 3.2.Секьюритизация страховых	3	4	ПК-6	Л1.1 Л1.2	0	

активов как инструмент управления инвестиционными рисками страховщика /Сем зан/				Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4		
Тема 3.2.Секьюритизация страховых активов как инструмент управления инвестиционными рисками страховщика /Ср/	3	8	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 3.3.Инновационные инструменты риск-менеджмента на финансовых рынках /Лек/	3	4	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 3.3.Инновационные инструменты риск-менеджмента на финансовых рынках /Сем зан/	3	6	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	
Тема 3.3.Инновационные инструменты риск-менеджмента на финансовых рынках /Ср/	3	8	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Л3.5 Э2 Э3 Э4	0	

### РАЗДЕЛ 3. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

В процессе освоения дисциплины Корпоративный риск-менеджмент используются следующие образовательные технологии: лекции (Л), семинарские занятия (СЗ), самостоятельная работа студентов (СР) по выполнению различных видов заданий.

В процессе освоения дисциплины Корпоративный риск-менеджмент используются следующие интерактивные

образовательные технологии: проблемная лекция (ПЛ). Лекционный материал представлен в виде слайд-презентации в формате «Power Point». 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 разноразовного задания.

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

### 4.1. Рекомендуемая литература

#### 1. Основная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	И. П. Хоминич [и др.]	Управление финансовыми рисками. Практикум: учебное пособие для вузов (129 с.)	Москва : Издательство Юрайт, 2021
Л1.2	В. Е. Барбаумов, М. А. Рогов, Д. Ф. Щукин	Корпоративный риск-менеджмент: Энциклопедия финансового риск-менеджмента (932 с.)	Москва : Альпина Бизнес Букс, 2020
Л1.3	Ларионова, И. А.	Риск-менеджмент : учебное пособие (32 с.)	Москва : Издательский Дом МИСиС, 2017
Л1.4	Мусаев, Л. А.	Менеджмент риска на предприятии: учебное пособие (190 с.)	Грозный : Грозненский государственный нефтяной технический университет имени академика М. Д. Миллионщикова, 2019
Л1.5	Капустина, Е. И., Григорьева, О. П., Скрипниченко, Ю. С., Молчаненко, С. А., Барсуков, М. Г.	Оценка рисков в проектном менеджменте: учебное пособие (152 с.)	Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет, 2017
Л1.6	Барбаумов, В. Е., Рогов, М. А., Щукин, Д. Ф., Ситникова, Н. Ю., Бурков, П. В., Тихомиров, С. Н., Лобанов, А. А., Замковой, С. В., Шпрингель, В. К., Голембиовский, Д. Ю.	Энциклопедия финансового риск-менеджмента: учебное пособие (932 с.)	Москва : Альпина Бизнес Букс, 2020

#### 2. Дополнительная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Афендикова Е. Ю.	Корпоративный риск-менеджмент: учебно-методическое пособие для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» (магистерская программа «Финансы и кредит») очной / заочной форм обучения (159 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2021
Л2.2	В. В. Петрушевской	Методологические и организационные процессы формирования финансовой системы: коллективная монография (506 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2020
Л2.3	Волощенко, Л. М.	Совершенствование теоретических основ финансового управления экономикой : коллективная	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2020

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
		монография (356 с.)	
Л2.4	Таскаева, Н. Н., Прохорова, Ю. С..	Антикризисное управление и риск-менеджмент: учебно-методическое пособие (47 с.)	Москва : МИСИ-МГСУ, ЭБС АСВ, 2020

### 3. Методические разработки

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Афендикова Е. Ю.	Корпоративный риск-менеджмент: практикум (159 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2018
Л3.2	Е.Ю. Афендикова	Корпоративный риск-менеджмент : конспект лекций для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа «Финансы и кредит») очной формы обучени (228 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2021
Л3.3	Е.Ю. Афендикова	Корпоративный риск-менеджмент: 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») очной формы обучения (53 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2021
Л3.4	Е. Ю. Афендикова	Корпоративный риск-менеджмент: 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») очной формы обучения (64 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2021
Л3.5	Е. Ю. Афендикова	Корпоративный риск-менеджмент : 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») очной формы обучения (46 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2021

#### 4.2. Перечень ресурсов

##### информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

Э1	Библиотека ГОУ ВПО «Донецкая академия управления и государственной службы при Главе Донецкой Народной Республики»	<a href="https://donampa.ru/biblioteka">https://donampa.ru/biblioteka</a>
Э2	НАРОДНЫЙ СОВЕТ ДНР	<a href="https://dnrsovet.su/zakonodatel'naya-deyatelnost/prinyatye/zakony/">https://dnrsovet.su/zakonodatel'naya-deyatelnost/prinyatye/zakony/</a>
Э3	Финансовые риски (нормативно–правовые акты, формы, статьи, консультации экспертов и многое другое).	<a href="http://www.consultant.ru/law/podborki/finansovye_riski/">http://www.consultant.ru/law/podborki/finansovye_riski/</a>
Э4	Нормативно-правовое обеспечение риск-менеджмента	<a href="https://cyberleninka.ru/article/n/normativno-pravovoe-obespechenie-risk-menedzhmenta">https://cyberleninka.ru/article/n/normativno-pravovoe-obespechenie-risk-menedzhmenta</a>

#### 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:

Microsoft OFFICE 2007 № лицензии 08.07.2008 № 44250460

Microsoft WINDOWS 7 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на копуре 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 ГОУ ВПО "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, семинарского типа, текущего контроля, групповых консультаций и промежуточной аттестации: аудитория № 301 учебный корпус № 2, г. Донецк, пр. Богдана Хмельницкого, 108 (ГОУ ВПО «ДОНАУИГС»):

- комплект мультимедийного оборудования: ноутбук, мультимедийный проектор, экран;  
 - 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).

20.2. 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 (ГОУ ВПО «ДОНАУИГС»), №6, г. Донецк, ул. Артема, 94 (ГОУ ВПО «ДОНАУИГС»).

Компьютерная техника с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду (ЭИОС ГОУ ВПО «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: AMD FX 8320/32Gb(4x8Gb)/4Tb(2x2Tb). На сервере установлена свободно распространяемая операционная система DEBIAN 10. MS Windows 8.1 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК ), MS Windows XP (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК ), MS Windows 7 (Лицензионная версия операционной системы подтверждена сертификатами подлинности системы Windows на корпусе ПК ), MS Office 2007 Russian OLP NL AE (лицензии Microsoft № 42638778, № 44250460), MS Office 2010 Russian (лицензии Microsoft № 47556582, № 49048130), MS Office 2013 Russian (лицензии Microsoft № 61536955, № 62509303, № 61787009, № 63397364), Grub loader for ALT Linux (лицензия GNU LGPL v3), Mozilla Firefox (лицензия MPL2.0), Moodle (Modular Object-Oriented Dynamic Learning Environment, лицензия GNU GPL), IncScape (лицензия GPL 3.0+), PhotoScape (лицензия GNU GPL), 1C ERP УП, 1C ЗУП (бесплатные облачные решения для образовательных учреждений от 1Cfresh.com), OnlyOffice 10.0.1 (SaaS, GNU Affero General Public License3)

## РАЗДЕЛ 5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

### 5.1. Контрольные вопросы и задания

Вопросы к экзамену:

1. Назовите основные подходы к классификации методов управления рисками.
2. В каком случае целесообразно использование метода отказа от риска. Приведите примеры.
3. В чем заключается суть метода предотвращения убытка. Приведите примеры.
4. В каком случае применение метода уменьшения размера убытка оправдано.
5. В каких формах возможно использование метода разделения риска на уровне фирмы.
6. В чем заключаются основные преимущества и недостатки метода аутсорсинга рисков.
7. Назовите возможные внутренние источники финансирования рисков.
8. В чем заключаются особенности использования метода покрытия убытка за счет использования займа.
9. Кэптивные страховые организации, преимущества их использования.
10. В чем заключается сущность страхования как метода управления риском.
11. Назовите основные виды финансовых рисков.
12. Цель и задачи управления финансовыми рисками.
13. Какие этапы управления финансовыми рисками выделяют.
14. Перечислите основные методические подходы к учету фактора риска в процессе управления финансовой деятельностью предприятия. Раскройте их содержание.
15. Назовите основные исходные положения, на которых основывается теория принятия решений в условиях

риска и неопределенности.

16. Система основных критериев, используемых в процессе принятия рискованных решений в условиях неопределенности.

17. Механизмы нейтрализации финансовых рисков.

18. Теоретические основы и этапы эволюции финансового риск-менеджмента.

19. Типичный риск-профиль предприятия. Сущность, основные черты, состав финансовых рисков предприятия.

20. Принципы и процесс управления финансовыми рисками: сущность и характеристика этапов.

### 5.2. Темы письменных работ

Вопросы к подготовке индивидуальных заданий:

1. Концептуальные подходы в развитии риск-менеджмента корпорации.
2. Специфика планирования в системе корпоративного риск-менеджмента.
3. Формирование системы управления корпоративными рисками в современных условиях.
4. Проблемы формирования системы управления рисками в российских организациях.
5. Риск-ориентированная система управления промышленными корпоративными структурами в современных условиях хозяйствования.
6. Риск мошенничества коррупции на карте ключевых бизнес-рисков корпорации.
7. Анализ особенностей и динамики развития Российского рынка производных финансовых инструментов.
8. Предприятия финансового и реального секторов экономики РФ на рынке производных инструментов: цели и задачи операций с деривативами.
9. Назначение, характеристика и особенности форвардных контрактов. Хеджирование рисков с использованием форвардных контрактов.
10. Сделки Свop, как инструменты управления финансовыми рисками.
11. Особенности функционирования рынка производных финансовых инструментов на основе фьючерсных контрактов. Виды, специфика, исполнение фьючерсных контрактов. Механизм фьючерсной маржи.
12. Хеджирование при помощи фьючерсных контрактов ценовых и финансовых рисков.
13. Финансовая природа опционов. Сущность и виды опционных контрактов.
14. Основные понятия рынка опционов и механизм его функционирования.

### 5.3. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств дисциплины "Корпоративный риск-менеджмент" разработан в соответствии с локальным нормативным актом "Порядок разработки и содержания фондов оценочных средств основной образовательной программы высшего профессионального образования в ГОУ ВПО "ДОНАУИГС".

Фонд оценочных средств дисциплины "Корпоративный риск-менеджмент" в полном объеме представлен в учебно-методическом комплексе дисциплины.

### 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 ГОУ ВПО "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 учебником, 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 методов исследования взаимосвязи между социально-экономическими и финансовыми факторами, 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.

**РЕЦЕНЗИЯ**  
**на РАБОЧУЮ ПРОГРАММУ И ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ**  
**ДИСЦИПЛИНЫ**

**Б1.В.11 « Корпоративный риск-менеджмент »**  
шифр дисциплины в учебном плане, наименование

**Направление подготовки** 38.04.08 Финансы и кредит  
код, наименование

**Магистерская программа** «Финансы и кредит»

**Разработчики:** Афендикова Е.Ю., доцент, канд.экон.наук, доцент  
(ФИО.НПР, участвовавших в разработке РПУД с указанием должности)

**Кафедра:** финансов

Представленная на рецензию рабочая программа и фонд оценочных средств дисциплины «Корпоративный риск-менеджмент» разработаны в соответствии с Государственным образовательным стандартом высшего профессионального образования по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (квалификация-магистр) (приказ Минобрнауки ДНР от 04.05.2020 г. №60-НП); Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования - магистратура по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 991).

Рабочая программа дисциплины содержит требования к уровню подготовки магистров по приобретению теоретических знаний и практических навыков, которые предъявляются к обучающимся данного направления подготовки в ходе изучения учебной дисциплины.

В рабочей программе сформулированы цели и задачи освоения дисциплины.

В разделе «Место дисциплины в структуре образовательной программы» указаны требования к предварительной подготовке обучающихся, а также последующие дисциплины, для которых изучение данной дисциплины будет необходимым.

В рабочей программе прописаны компетенции обучающегося (ПК-6), формируемые в результате освоения дисциплины.

Раздел «Структура и содержание дисциплины» содержит тематическое и почасовое распределение изучаемого материала по видам занятий, а также часы на самостоятельную работу.

В разделе «Фонд оценочных средств» указаны оценочные средства для текущего контроля и промежуточной аттестации обучающегося (фонд оценочных средств представлен отдельным элементом УМКД).

Компетенции по курсу, указанные в рабочей программе, полностью соответствуют учебному плану и матрице компетенций.

В рабочей программе дисциплины представлен также перечень материально-технического обеспечения для осуществления всех видов занятий, предусмотренных учебным планом.

Рабочая программа дисциплины имеет логически завершённую структуру, включает в себя все необходимые и приобретаемые в процессе изучения навыки и умения.

Учебно-методическое обеспечение дисциплины представлено в программе перечнем основной и дополнительной литературы, методических материалов, библиотечно-информационных ресурсов, что является достаточным для успешного владения дисциплиной.

Таким образом, рабочая программа дисциплины «Корпоративный риск-менеджмент» соответствует всем требованиям к реализации программы и может быть рекомендована к использованию.

Рецензент:  
доцент, канд.экон.наук, доцент  
(должность, регалии)



О.В. Титиевская  
ФИО

МП

Дата 26.08.2021