

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 Финансовых услуг и банковского дела



"УТВЕРЖДАЮ"
Проректор по УРиМС
Л.Н. Костина
26.08.2021 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА
УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ**

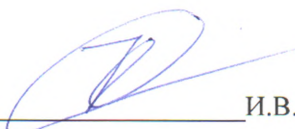
Б1.В.07 "Управление рисками хозяйствующих субъектов"

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

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

Донецк
2021

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


И.В. Кравцова

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


Ю.Н. Ковалева

Рабочая программа дисциплины "Управление рисками хозяйствующих субъектов" 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 Донецкой Народной Республики 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)

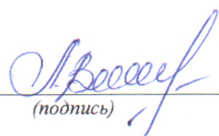
Рабочая программа дисциплины составлена на основании учебного плана: Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит
Магистерская программа "Налоги и налогообложение", утвержденного Ученым советом ГОУ ВПО "ДОНАУИГС" от 26.08.2021 протокол № 1/4.

Срок действия программы: 2021-2023 уч. г.

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры финансовых услуг и банковского дела

Протокол от 26.08.2001 № 1

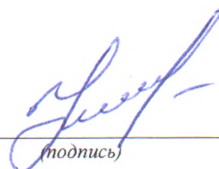
Заведующий кафедрой:
д-р экон.наук, доцент, Волощенко Л.М.


(подпись)

Одобрено Предметно-методической комиссией кафедры финансовых услуг и банковского дела

Протокол от 26.08.2021 № 1

Председатель ПМК:
канд.экон.наук, доцент, Погоржельская Н.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 Финансовых услуг и банковского дела

Протокол от " ____ " _____ 2022 г. №__

Зав. кафедрой д-р экон. наук, доцент Волощенко Л.М. _____ (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 Финансовых услуг и банковского дела

Протокол от " ____ " _____ 2023 г. №__

Зав. кафедрой д-р экон. наук, доцент Волощенко Л.М. _____ (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 Финансовых услуг и банковского дела

Протокол от " ____ " _____ 2024 г. №__

Зав. кафедрой д-р экон. наук, доцент Волощенко Л.М. _____ (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 Финансовых услуг и банковского дела

Протокол от " ____ " _____ 2025 г. №__

Зав. кафедрой д-р экон. наук, доцент Волощенко Л.М. _____ (подпись)

РАЗДЕЛ 1. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ

1.1. ЦЕЛИ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель изучения дисциплины «Управление рисками хозяйствующих субъектов» - формирование у обучающихся прочной теоретической, методологической и практической базы для понимания экономического анализа деятельности хозяйствующих субъектов в условиях рискованных ситуаций.

1.2. УЧЕБНЫЕ ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

Задачи изучения дисциплины:

- изучение теоретических и методологических основ управления рисками;
- изучение теоретических и практических основ разработки, внедрения и контроля системы управления рисками;
- решение практических задач, связанных с созданием системы управления рисками на предприятиях и в организациях различных отраслей экономики и форм собственности.

1.3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОСНОВНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Цикл (раздел) ОПОП ВО: Б1.В

1.3.1. Дисциплина "Управление рисками хозяйствующих субъектов" опирается на следующие элементы ОПОП ВО:

Инновационные банковские продукты и технологии

Стратегии и современная модель управления в сфере денежно-кредитных отношений

Финансовые рынки и финансово-кредитные институты

Финансовый анализ (продвинутый уровень)

Актуальные проблемы финансов

Налоговое администрирование (продвинутый уровень)

Страхование (продвинутый уровень)

Финансовый менеджмент (продвинутый уровень)

1.3.2. Дисциплина "Управление рисками хозяйствующих субъектов" выступает опорой для следующих элементов:

Анализ и оценка деятельности хозяйствующих субъектов (продвинутый уровень)

Трансформация финансовой отчетности и национальных стандартов в МСФО

Финансовые и денежно-кредитные методы регулирования экономики

1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:

ПК-8: Способен разрабатывать и внедрять в практику эффективные методы правомерной налоговой оптимизации, предотвращать негативные последствия налоговых правонарушений, раскрывать схемы неправомерного уклонения от уплаты налогов

Знать:

Уровень 1 | сущность и виды рисков в отечественной и зарубежной практике хозяйствующих субъектов;

Уровень 2 | механизмы практического использования инструментов управления рисками в условиях финансового рынка;

Уровень 3 | методы оценки рисков в соответствии с нормативными требованиями

Уметь:

Уровень 1 | выделять специфику рисков хозяйствующих субъектов и определять возможность использования конкретных методов минимизации потерь;

Уровень 2 | выявлять факторы, оказывающие влияние на риски хозяйствующих субъектов;

Уровень 3 | определять значения показателей, характеризующих определённый вид риска

Владеть:

Уровень 1 | практическими навыками расчета рисков хозяйствующих субъектов;

Уровень 2 | способами анализа качества рисков хозяйствующих субъектов;

Уровень 3 | практическими навыками определения экономической эффективности деятельности хозяйствующих субъектов, имеющей высокий уровень риска

1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:

ПК-6: Способен управлять экономическими рисками, инвестициями, финансовыми потоками на

<i>основе интеграции знаний из смежных областей, нести ответственность за принятые организационно-управленческие решения</i>	
Знать:	
Уровень 1	принципы управления банковскими рисками;
Уровень 2	современные концепции управления рисками и способы их снижения;
Уровень 3	критерии эффективности решений, инструменты их обработки, методы анализа и обоснования полученных выводов в области риск-менеджмента по оптимизации рисков хозяйствующих субъектов
Уметь:	
Уровень 1	анализировать альтернативные варианты управленческих решений в области финансового риск-менеджмента;
Уровень 2	разрабатывать альтернативные варианты управленческих решений в области финансового риск-менеджмента;
Уровень 3	обосновать альтернативные варианты управленческих решений в области финансового риск-менеджмента
Владеть:	
Уровень 1	навыками прогнозирования экономических последствий принимаемых решений;
Уровень 2	навыками разработки рискованной стратегии организации;
Уровень 3	навыками реализации рискованной стратегии организации

В результате освоения дисциплины "Управление рисками хозяйствующих субъектов"

3.1	Знать:
	сущность и виды рисков в отечественной и зарубежной практике хозяйствующих субъектов;
	механизмы практического использования инструментов управления рисками в условиях финансового рынка;
	методы оценки рисков в соответствии с нормативными требованиями;
	принципы управления банковскими рисками;
	современные концепции управления рисками и способы их снижения;
	критерии эффективности решений, инструменты их обработки, методы анализа и обоснования полученных выводов в области риск-менеджмента по оптимизации рисков хозяйствующих субъектов.
3.2	Уметь:
	выделять специфику рисков хозяйствующих субъектов и определять возможность использования конкретных методов минимизации потерь;
	выявлять факторы, оказывающие влияние на риски хозяйствующих субъектов;
	определять значения показателей, характеризующих определённый вид риска;
	анализировать, разрабатывать и обосновать альтернативные варианты управленческих решений в области финансового риск-менеджмента
3.3	Владеть:
	практическими навыками расчета рисков хозяйствующих субъектов;
	способами анализа качества рисков хозяйствующих субъектов;
	практическими навыками определения экономической эффективности деятельности хозяйствующих субъектов, имеющей высокий уровень риска;
	навыками прогнозирования экономических последствий принимаемых решений, навыками разработки и реализации рискованной стратегии организации

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 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 "Порядок организации текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации в ГОУ ВПО "ДОНАУИГС". По дисциплине "Управление рисками хозяйствующих субъектов" видом промежуточной аттестации является Экзамен

РАЗДЕЛ 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

2.1. ТРУДОЕМКОСТЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоёмкость дисциплины "Управление рисками хозяйствующих субъектов" составляет 4 зачётные единицы, 144 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. Понятие риска						
Тема 1.1. Понятие риска в экономике /Лек/	2	4	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.3Л3.1 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.1. Понятие риска в экономике /Сем зан/	2	4	ПК-6	Л1.3 Л1.4Л2.2 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.4 Э4 Э5 Э6	0	
Тема 1.1. Понятие риска в экономике /Ср/	2	4	ПК-6	Л1.1 Л1.3Л2.2 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.5 Э7 Э8 Э9	0	
Тема 1.2. Общая классификация рисков /Лек/	2	2	ПК-8	Л1.2 Л1.4Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э6 Э7 Э8	0	
Тема 1.2. Общая классификация рисков /Сем зан/	2	2	ПК-8	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.4Л3.1 Л3.3 Л3.5 Э10 Э11 Э12	0	
Тема 1.2. Общая классификация рисков /Ср/	2	3	ПК-8	Л1.1 Л1.3Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.4 Л3.5 Э13 Э14 Э15	0	
Тема 1.3. Место и роль риск – менеджмента	2	4	ПК-6	Л1.4	0	

в экономике предприятия /Лек/				Л1.2Л2.1 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.4 Э7 Э10 Э13		
Тема 1.3. Место и роль риск – менеджмента в экономике предприятия /Сем зан/	2	4	ПК-6	Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.3 Л3.5 Л3.4 Э15 Э17	0	
Тема 1.3. Место и роль риск – менеджмента в экономике предприятия /Ср/	2	4	ПК-6	Л1.2 Л1.4Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.4 Л3.5 Л3.3 Э10 Э13	0	
Раздел 2. Риски на предприятии						
Тема 2.1. Организация системы риск-менеджмента на предприятии /Лек/	2	4	ПК-8	Л1.1 Л1.4Л2.1 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.5 Э15 Э16 Э17	0	
Тема 2.1. Организация системы риск-менеджмента на предприятии /Сем зан/	2	4	ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.2 Л2.4 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.4 Л3.5 Э1 Э10 Э11	0	
Тема 2.1. Организация системы риск-менеджмента на предприятии /Ср/	2	4	ПК-8	Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2 Л2.4Л3.1 Л3.2 Э10 Э11 Э12	0	
Тема 2.2. Методы минимизации рисков хозяйствующего субъекта. Страхование и резервирование /Лек/	2	4	ПК-8	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.5 Э1 Э6 Э9	0	
Тема 2.2. Методы минимизации рисков хозяйствующего субъекта. Страхование и резервирование /Сем зан/	2	4	ПК-8	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.2 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.2. Методы минимизации рисков хозяйствующего субъекта. Страхование и резервирование /Ср/	2	3	ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.2Л3.1	0	

				Л3.2 Л3.4 Л3.5 Л3.3 Э5 Э6 Э7		
Тема 2.3. Хеджирование, лимитирование, диверсификация и избежание риска /Лек/	2	4	ПК-6	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.4 Л3.5 Э1 Э6 Э7	0	
Тема 2.3. Хеджирование, лимитирование, диверсификация и избежание риска /Сем зан/	2	4	ПК-6	Л1.1 Л1.4Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.4 Л3.5 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.3. Хеджирование, лимитирование, диверсификация и избежание риска /Ср/	2	3	ПК-6	Л1.1 Л1.3 Л1.4Л2.2 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.5 Э6 Э8 Э9	0	
Раздел 3. Организация работы по управлению рисками						
Тема 3.1. Ценовые риски /Лек/	2	4	ПК-8	Л1.1 Л1.2Л2.2 Л2.4 Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.4 Л3.5 Э1 Э3 Э5	0	
Тема 3.1. Ценовые риски /Сем зан/	2	4	ПК-8	Л1.1 Л1.2 Л1.3Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2 Л3.5 Э3 Э4 Э6	0	
Тема 3.1. Ценовые риски /Ср/	2	4	ПК-8	Л1.1 Л1.2 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2	0	
Тема 3.2. Кредитные риски /Лек/	2	2	ПК-6	Л1.1 Л1.2Л2.1 Л2.5Л3.1 Л3.4 Л3.5 Э1 Э5 Э6 Э7	0	
Тема 3.2. Кредитные риски /Сем зан/	2	2	ПК-6	Л1.2 Л1.3Л2.5 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.4 Э3 Э4 Э5	0	
Тема 3.2. Кредитные риски /Ср/	2	4	ПК-6	Л1.1 Л1.4Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.2	0	

				Э1 Э2 Э3		
Тема 3.3. Операционные риски /Лек/	2	2	ПК-6	Л1.1 Л1.2Л2.1Л3 .1 Л3.2 Э7 Э8 Э9	0	
Тема 3.3. Операционные риски /Сем зан/	2	2	ПК-6	Л1.1 Л1.4Л2.1 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.5 Э1 Э2 Э4 Э5	0	
Тема 3.3. Операционные риски /Ср/	2	4	ПК-6	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.2 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.4 Э5 Э6 Э7	0	
/Конс/	2	3			0	
Раздел 4. Налоговые риски						
Тема 4.1. Налоговые риски /Лек/	2	2	ПК-8	Л1.1 Л1.4Л2.2Л3 .1 Л3.2 Л3.4 Э1 Э2 Э4 Э8	0	
Тема 4.1. Налоговые риски /Сем зан/	2	2	ПК-8	Л1.2 Л1.4Л2.2 Л2.4Л3.1 Л3.5 Э3 Э4 Э5	0	
Тема 4.1. Налоговые риски /Ср/	2	4	ПК-8	Л1.2 Л1.4Л2.1 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э3 Э4 Э7 Э8	0	
Тема 4.2. Инвестиционные риски /Лек/	2	2	ПК-6	Л1.1 Л1.3Л2.1 Л2.3 Л2.4Л3.1 Л3.2 Л3.4 Э1 Э7 Э9	0	
Тема 4.2. Инвестиционные риски /Сем зан/	2	2	ПК-6	Л1.2 Л1.4Л2.1 Л2.2Л3.1 Л3.5 Л3.4 Э7 Э9 Э10	0	
Тема 4.2. Инвестиционные риски /Ср/	2	2	ПК-6	Л1.2 Л1.3Л2.1	0	

				Л2.3Л3.1 Л3.2 Л3.4 Л3.5 Э2 Э5 Э8		
Тема 4.3. Риски финансового мошенничества /Лек/	2	2	ПК-8	Л1.1 Л1.3Л2.2 Л2.4Л3.1 Л3.2 Э5 Э6 Э7	0	
Тема 4.3. Риски финансового мошенничества /Сем зан/	2	2	ПК-8	Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.1 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.4 Э6 Э7 Э8	0	
Тема 4.3. Риски финансового мошенничества /Ср/	2	3	ПК-8	Л1.2 Л1.4Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5Л3.1 Л3.2 Л3.3 Л3.5 Л3.4 Э3 Э4 Э7	0	

РАЗДЕЛ 3. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

3.1 В процессе освоения дисциплины «Управление рисками хозяйствующих субъектов» используются следующие образовательные технологии: лекции (Л), семинарские занятия (СЗ), самостоятельная работа студентов (СР) по выполнению различных видов заданий.

3.2 В процессе освоения дисциплины «Управление рисками хозяйствующих субъектов» используются следующие интерактивные образовательные технологии: проблемная лекция (ПЛ). Лекционный материал представлен в виде слайд-презентации в формате «Power Point». Для наглядности используются материалы различных справочных материалов, научных статей т.д. В ходе лекции предусмотрена обратная связь со студентами, активизирующие вопросы, просмотр и обсуждение видеофильмов. 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.

3.3 Самостоятельная работа предназначена для внеаудиторной работы студентов, связанной с конспектированием источников, учебного материала, изучением дополнительной литературы по дисциплине, подготовкой к текущему и семестровому 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	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
Л1.2	Е. А. Аксёнова	Управление финансово-экономическими рисками: учебно-методическое пособие для обучающихся 2	ГОУ ВПО "ДОНАУИГС", 2020

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
		курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа «Финансы государственного сектора») очной формы обучения / Минобрнауки ДНР, ГОУ ВПО «ДОНАУиГС», (128 с.)	
Л1.3	И. П. Хоминич [и др.]	Управление финансовыми рисками. Практикум: учебное пособие для вузов (129 с.)	Москва : Издательство Юрайт, 2021
Л1.4	Т. В. Денисова	Управление финансовыми рисками : учебное пособие (192 с.)	Ульяновск : УЛГТУ, 2021

2. Дополнительная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Афендикова Е. Ю.	Корпоративный риск-менеджмент: практикум (159 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУиГС", 2018
Л2.2	Л. М. Волощенко, Е. Ю. Афендикова	Корпоративный риск-менеджмент: учебно-методическое пособие (185 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУиГС", 2016
Л2.3	Таскаева, Н. Н., Прохорова, Ю. С.	Антикризисное управление и риск-менеджмент : учебно-методическое пособие (47 с.)	Москва : Издательство МИСИ – МГСУ, 2020
Л2.4	Сорокин, Л. В.	Управление рисками международных проектов: учебное пособие (64 с.)	Москва : РУДН, 2019
Л2.5	В.Е. Барбаумов [и др.]	Энциклопедия финансового риск-менеджмента: учебное пособие (932 с.)	Москва : Альпина Бизнес Букс, 2020

3. Методические разработки

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	О. Э. Кириенко	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.)	ГОУ ВПО «ДОНАУиГС», 2018
Л3.2	А. И. Ярембаш	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.)	ГОУ ВПО "ДОНАУиГС", 2018
Л3.3	И.В. Кравцова	Управление рисками хозяйствующих субъектов: конспект лекций для студентов 1 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа «Налоги и налогообложение») очной формы обучения (277 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУиГС", 2021
Л3.4	И.В. Кравцова	Управление рисками хозяйствующих субъектов: методические рекомендации для проведения семинарских занятий для студентов 1 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа «Налоги и налогообложение») очной формы обучения (27 с.)	ГОУ ВПО "ДОНАУиГС", 2021
Л3.5	И.В. Кравцова	Управление рисками хозяйствующих субъектов: методические рекомендации по организации самостоятельной работы для студентов 1 курса	ГОУ ВПО "ДОНАУиГС", 2021

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
		образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (магистерская программа «Налоги и налогообложение») очной формы обучения (13 с.)	
4.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"			
Э1	Официальный сайт Центрального Банка России	http://www.cbr.ru	
Э2	Информационный Портал ГАРАНТ	www.garant.ru/news/tag/572	
Э3	Консалтинговая компания ДНР-Консалтинг	http://dnr-consulting.com/	
Э4	Сайт Министерства доходов и сборов Донецкой Народной Республики	http://mdsdnr.ru/	
Э5	Сайт Министерства финансов РФ.	http://www.minfin.ru	
Э6	Официальный сайт ДНР	https://dnronline.su /	
Э7	Информационно-правовая система Консультант Плюс	http://www.consultant.ru/	
Э8	Ассоциация региональных банков России	http://www.asros.ru/	
Э9	Ассоциация российских банков	http://www.arb.ru/	
Э10	Информационный портал: банки, вклады, кредиты, ипотека, рейтинги российских банков	http://www.banki.ru/	
Э11	Сайт Центрального республиканского банка ДНР	https://crb-dnr.ru/	
Э12	Финансы и кредит: современное состояние банковского рынка РФ	http://finansi-credit.ru	
Э13	Информационное агентство Bankir.Ru	http://bankir.ru/	
Э14	Аналитический банковский журнал	http://www.abajour.ru/	
Э15	Национальный институт системных исследований проблем предпринимательства	http://www.nisse.ru/	
Э16	. Бизнес. ИТ. Обзоры. Аналитика. TAdviser	https://www.tadviser.ru/index.php/Аналитика_TAdviser	
Э17	Futurebanking: инновации в банках	http://futurebanking.ru/?page=3#new-posts	
4.3. Перечень программного обеспечения			
Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства:			
Информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса по дисциплине "Управление рисками хозяйствующих субъектов":			
использование электронных презентаций, электронного курса лекций;			
организация взаимодействия с обучающимися посредством электронной почты, форумов, интернет-групп, скайпа, чатов.			
Программное обеспечение включает в себя:			
Windows 8.1 Professional x86/64 (академическая подписка DreamSpark Premium), 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), Mozilla Firefox (лицензия MPL2.0), LibreOffice 4.3.2.2 (лицензия GNU LGPL v3+ и MPL2.0)			
4.4. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы			
Официальный сайт Центрального Банка России. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://www.cbr.ru			
Информационный Портал ГАРАНТ. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://www.garant.ru/news/tag/572			
Консалтинговая компания ДНР-Консалтинг. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: http://dnr-consulting.com/			

Сайт Министерства доходов и сборов Донецкой Народной Республики. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://mdsdnr.ru/>

Сайт Министерства финансов РФ. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.minfin.ru>

Официальный сайт ДНР. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://dnronline.su/>

Информационно-правовая система Консультант Плюс. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.consultant.ru/>

Ассоциация региональных банков России. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.asros.ru/>

Ассоциация российских банков. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.arb.ru/>

Информационный портал: банки, вклады, кредиты, ипотека, рейтинги российских банков. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.banki.ru/>

Сайт Центрального республиканского банка ДНР. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://crb-dnr.ru/>

Финансы и кредит: современное состояние банковского рынка РФ. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://finans-credit.ru>

Информационное агентство Bankir.Ru. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://bankir.ru/>

Аналитический банковский журнал. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.abajour.ru/>

Национальный институт системных исследований проблем предпринимательства. – [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <http://www.nisse.ru/>

4.5. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебные аудитории. Мультимедийный проектор и ПК. Раздаточный материал к отдельным темам лекций и семинарским занятиям, презентации.

1. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного и семинарского типа, текущего контроля, консультаций, групповых консультаций и промежуточной аттестации: № 402 учебный корпус №6. – комплект мультимедийного оборудования: ноутбук, мультимедийный проектор, Windows 8.1 Professional x86/64. - специализированная мебель: рабочее место преподавателя, рабочие места обучающихся (40), стационарная доска, проектор, экран, демонстрационные плакаты. (академическая подписка DreamSpark Premium), LibreOffice 4.3.2.2 (лицензия GNU LGPL v3+ и MPL2.0)(6 учебный корпус, г. Донецк, ул. Артема 94 (ГОУ ВПО «ДОНАУИГС»)).

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, 6. Адрес: г. Донецк, ул. Челюскинцев 163а, г. Донецк, ул. Артема 94.

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 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), Mozilla Firefox (лицензия MPL2.0), Moodle (Modular Object-Oriented Dynamic Learning Environment, 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)(1 учебный корпус, г. Донецк, ул. Челюскинцев 163а (ГОУ ВПО «ДОНАУИГС»), 6 учебный корпус, г. Донецк, ул. Артема 94 (ГОУ ВПО «ДОНАУИГС»)).

РАЗДЕЛ 5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

5.1. Контрольные вопросы и задания

Вопросы к экзамену по дисциплине:

Раздел 1. Понятие риска

Тема 1.1 Понятие риска в экономике.

1.Риск, его понятие, сущность.

2.Вероятностный характер риска.

3.Объективный характер возникновения риска и субъективность его оценки.

Тема 1.2. Общая классификация рисков.

4.Общая классификация рисков.

5.Чистые и спекулятивные риски.

Тема 1.3. Место и роль риск – менеджмента в экономике предприятия.

6.Зависимость неопределенности внешней среды функционирования и эффективности предпринимательской

деятельности.

7.Общий график «риск-прибыль».

Тема 1.4. Организация системы риск-менеджмента на предприятии.

8.Историческое развитие системы управления риском предприятия.

9.Понятие и задачи регламента управления рисками.

10. Принципы построения системы управления рисками

11.Основные методы оценки уровня рисков.

Тема 1.5. Методы минимизации рисков хозяйствующего субъекта. Страхование и резервирование.

12. Понятие «управление рисками».

13. Основные методы управления рисками, их характеристика.

Тема 1.6. Хеджирование, лимитирование, диверсификация и избежание риска.

14. Хеджирование как метод управления рисками.

15. Диверсификация (распределение) как метод управления риском.

16. Минимизация (лимитирование) как метод управления риском.

17. Избежание как метод управления риском.

18. Поглощение риска.

Раздел.2. Классификация рисков

Тема 2.1 Ценовые риски.

19.Цены на выпускаемые продукты.

20.Цены на материально-технические ресурсы.

21. Волатильность цен на продукты.

22. Моделирование по методу Монте-Карло.

Тема 2.2 Кредитные риски.

23. Классификация кредитных рисков.

24. Этапы управления кредитными рисками.

Тема 2.3. Операционные риски.

25. Классификация операционных рисков.

26. Понятие операционного риска.

Тема 2.4 Налоговые риски.

27.Понятие налогового риска.

28. Классификация налоговых рисков.

29. Управление налоговыми рисками.

Тема 2.5 Инвестиционные риски.

30.Инвестиционная деятельность и инвестиция.

31. Классификация инвестиций по объектам вложения.

32. Классификация: по отношению к объекту вложения.

Тема 2.6. Риски финансового мошенничества.

33.Понятие мошенничества.

34.Особенности организации системы противодействия финансовому мошенничеству на предприятии.

35. Система внутреннего контроля как элемент системы противодействия финансовому мошенничеству.

5.2. Темы письменных работ

Тематика рефератов

1.Классификационные признаки рисков:

- природа возникновения (объективный, субъективный риск);
- этап решения проблемы (принятие решения, реализация решения);
- масштаб (локальный, отраслевой, региональный, национальный,международный риск);
- сфера возникновения (внешний, внутренний риск);
- объект риска (ликвидности, акционерной стоимости, снижения прибыли и пр.)
- вид предпринимательской деятельности (финансовый, юридический, производственный, коммерческий, инвестиционный, страховой,инновационный риск);
- возможность страхования (страхуемый, нестрахуемый риск);
- возможность диверсификации (систематический, специфический);
- степень допустимости (минимальный, повышенный, критический, недопустимый риск)

2.Значение риска в предпринимательской деятельности.

3. Понятие экономического риска. Основные черты, присущие экономическому риску.

4.Историческое развитие взглядов ведущих экономистов на понятие риска.

5.Основные научные концепции риска.

6.Классическая и неоклассическая теория предпринимательских рисков.

7.Классическое понимание риска как возможности возникновения потерь (ущерба) от предпринимательской деятельности.

8. Величина прибыли и ее колебания как основы неоклассической теории предпринимательских рисков.
Тема 1.3. Место и роль риск – менеджмента в экономике предприятия.
9. Необходимость выявления, анализа и управления рисками предприятия.
10. Понятие и значение интегрированного риска предприятия.
11. Историческое развитие взглядов на понятие интегрированного риска.
Роль интегрированного риска в обеспечении капитализации компании в современных условиях развития экономики.
12. Доля отдельных рисков в общем показателе уровня интегрированного риска.
Тема 1.4. Организация системы риск-менеджмента на предприятии.
13. Место и роль подразделения по управлению рисками в системе корпоративного управления предприятия.
14. Зависимость его организационно–штатной структуры от размера и профиля деятельности предприятия.
15. Место и роль внутреннего аудита в системе управления рисками предприятия
16. Обоснование связи риск менеджмента с науками.
17. Задачи риск менеджмента (выявление, оценка, анализ, управление рисками и пр.).
18. Неразрывность зависимости стратегии и тактики риск менеджмента.
19. Стратегический риск менеджмент как система управления риском, основанная на долгосрочном прогнозировании, стратегическом планировании, долгосрочных целях предприятия.
20. Tактический риск менеджмент как совокупность приемов и способов, использующихся в конкретной хозяйственной ситуации для достижения целей стратегического риск менеджмента.
- Тема 1.5. Методы минимизации рисков хозяйствующего субъекта. Страхование и резервирование.
21. Страхование как метод управления рисками предприятия.
22. Историческое развитие института страхования.
23. Основные понятия (термины), применяемые в страховании (страховщик, страхователь, страховой тариф, страховая премия, франшиза и пр.)
24. Полное и частичное страхование рисков.
25. Основные преимущества страхования как метода управления риском.
26. Объективные и субъективные недостатки страхования как метода управления риском.
27. Критерии выбора страховой компании.
28. Понятие кэптивной страховой компании.
29. Преимущества и недостатки кэптивного страхования.
30. Риск менеджмент как составная часть корпоративной системы управления.
31. Самострахование (резервирование) как метод управления рисками.
32. Способы формирования резервного фонда.
33. Экономические и управленческие преимущества самострахования как метода управления риском.
34. Недостатки самострахования.
35. Сфера применения самострахования в зависимости от конкретного вида риска.
36. Предпосылки возникновения хеджирования.
37. Финансовые инструменты, применяемые при хеджировании.
38. Сфера применения хеджирования в зависимости от конкретного вида риска.
39. Сфера применения диверсификации в зависимости от конкретного вида риска (систематический, специфический).
40. Сфера применения лимитирования в зависимости от конкретного вида риска.
41. Рисковая политика предприятия и лимитирование.
42. Положительные и отрицательные стороны избежания риска.
43. Обоснование выбора применяемого метода управления в зависимости от вероятности и уровня риска.
Тема 1.6. Хеджирование, лимитирование, диверсификация и избежание риска.
44. Предпосылки возникновения хеджирования.
45. Финансовые инструменты, применяемые при хеджировании.
46. Сфера применения хеджирования в зависимости от конкретного вида риска.
47. Сфера применения диверсификации в зависимости от конкретного вида риска (систематический, специфический).
48. Сфера применения лимитирования в зависимости от конкретного вида риска.
49. Рисковая политика предприятия и лимитирование.
50. Положительные и отрицательные стороны избежания риска.
51. Сфера применения поглощения риска.
- Раздел.2. Классификация рисков
Тема 2.1 Ценовые риски.
52. Временной горизонт планирования.
53. Доверительный уровень вероятности. RiskMetrics и CorporateMetrics.
54. Планируемый показатель денежного потока или дохода Компании.

55. Генерация сценариев факторов риска: прогнозирование трендов факторов риска, генерация сценариев посредством имитационного моделирования факторов риска.
56. Этапы моделирования по методу Монте-Карло.
57. Основные элементы управления кредитным риском.
- Тема 2.2 Кредитные риски.
58. Прямой кредитный риск.
59. Риск дефолта по ценным бумагам (непогашения долгового обязательства, невыплаты купонов и т.д.).
60. Риск неисполнения забалансовых обязательств,
61. Риск по производным финансовым инструментам.
62. Расчетный риск.
- Тема 2.3. Операционные риски.
63. Классификация финансовых потерь, вызванных операционными рисками.
64. Классификация событий приводящих к потерям по операционным рискам.
65. Риски организационной структуры управления.
66. Риски персонала.
67. Производственные риски.
- Тема 2.4 Налоговые риски.
68. Внутренний и внешний налоговый риск.
69. Понятия налогового бремени, коэффициента и периода оборота денежных средств.
70. Факторы внутренних и внешних налоговых рисков.
71. Объекты налогового риска.
72. Оценка налоговых рисков.
73. Взаимосвязь странового и налогового риска.
74. Факторы и рейтинги странового риска.
75. Лимитирование как метод управления рисками.
76. Управление риском изменения налогового законодательства.
77. Управление риском налогового контроля.
78. Управление риском уголовного преследования.
- Тема 2.5 Инвестиционные риски.
79. Реальные инвестиции.
80. Финансовые инвестиции
81. Стратегические инвестиции,
82. Базовые инвестиции.
83. Текущие инвестиции и новационные инвестиции.
- Тема 2.6. Риски финансового мошенничества.
90. Юридическое толкование мошенничества и западное расширительное понимание финансового мошенничества.
91. Корреспонденция норм Уголовного кодекса и мошеннических действий.
92. Особенности организации системы противодействия финансовому мошенничеству на предприятии.
93. Концепция (политика) предприятия по противодействию мошенничеству.
94. Нормативные документы, регламентирующие обязанности сотрудников/отделов за конкретные сферы деятельности или операции коммерческого банка.
95. Инструкции, регламентирующие процедуры противодействия мошенничеству.
96. Модель Ассоциации сертифицированных специалистов по расследованию мошенничества (ACFE).
97. Предотвращение мошенничества.
98. Выявление мошенничества.
99. Расследование мошенничества.
100. Финансовые коэффициенты как инструмент выявления признаков финансового мошенничества («красные флажки»).
101. Методы противодействия финансовому мошенничеству.
102. Система внутреннего контроля как элемент системы противодействия финансовому мошенничеству на предприятии.
103. Контрольная среда, система учета, процедуры контроля.

ТЕМАТИКА ДОКЛАДОВ/СООБЩЕНИЙ

Раздел 1. Понятие риска

Тема 1.1 Понятие риска в экономике.

1. Понятие «риск» и краткая история развития рисков на предприятии.
2. Сущность рисков и взаимосвязь их с неопределенностью.
3. Виды и функции экономических рисков.

4. Мифы о рисках. Вероятности риска.
5. Методы оценки эффективности управления рисками.
Тема 1.2. Общая классификация рисков.
6. Подходы к оценке уровня риска.
7. Зоны риска. Степень риска.
8. Подходы к управлению рисками.
9. Организация контроля и выявления риска на предприятии.
10. Рекомендации по управлению уровнем риска.
Тема 1.3. Место и роль риск – менеджмента в экономике предприятия.
11. Взаимосвязь надежности, неопределенности и рисков.
12. Страхование как метод снижения риска, особенности страхования рисков, страховой случай, классификация страхования рисков.
13. Перестрахование при управлении риском на предприятии.
14. Особенности формирования внутреннего и внешнего фонда рисков, оптимальный размер фонда риска предприятия.
15. Методы оценки вероятности неблагоприятных событий.
16. Диверсификация как метод снижения риска.
17. Критерии оценки эффективности применения методов управления рисками на предприятии.
18. Мероприятия по управлению риском и их влияние на стоимость предприятия.
19. Риск-менеджмент предприятия. Стратегия и тактика управления.
20. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности. Критерии отбора наилучшего варианта решения.
21. Страновые риски их значение при ведении внешнеэкономической деятельности на предприятии.
22. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности. Критерии отбора наилучшего варианта решения.
23. Инвестиционные риски и их место в инвестиционном проекте.
24. Самострахование, его необходимость в целях минимизации риска.
25. Финансирование риска на предприятии.
26. Экономико-организационные и социальные аспекты формирования рисков.
27. Анализ предпринимательских рисков.
28. Оценка предпринимательских рисков.
29. Методы управления предпринимательскими рисками.
30. Синергетический подход в риск-менеджменте.
31. Сущность риска, его свойства и основания. Взаимосвязь теории риска с другими науками. Классификация рисков.
32. Сущность и содержание управления рисками.
33. Этапы процесса управления рисками.
34. Методы управления рисками предприятий.
35. Перспективы применения основных принципов синергетики к исследованию рисков предприятий.
36. Эволюция научных представлений о риске.
37. Механизм риск-менеджмента: ресурсная составляющая, организационная составляющая, системы обеспечения.
38. Качественный и количественный подходы к анализу предпринимательских рисков.
39. Способы выявления наличия риска в альтернативах.
40. Последовательность этапов оценки риска предприятий

Тематика эссе

Раздел 1. Понятие риска

1. Содержание, оценка и управление факторами риска, оказывающими решающее влияние в современных условиях развития экономики России на результативность производственного предпринимательства.
2. Содержание, оценка и управление факторами риска, оказывающими решающее влияние в современных условиях развития экономики России на результативность торгового бизнеса.
3. Содержание, оценка и управление факторами риска, оказывающими решающее влияние в современных условиях развития экономики России на результативность строительного бизнеса.

4. Содержание, оценка и управление факторами риска, оказывающими решающее влияние в современных условиях развития экономики России на результативность банковской деятельности.
5. Содержание, оценка и управление факторами риска, оказывающими решающее влияние в современных условиях развития экономики России на результативность страхового бизнеса.
6. Содержание, оценка и управление факторами риска, оказывающими решающее влияние в современных условиях развития экономики России на результативность сельскохозяйственной деятельности.
7. Содержание, оценка и управление факторами риска, оказывающими решающее влияние в современных условиях развития экономики России на результативность инновационной деятельности.

Раздел.2. Классификация рисков

8. Содержание, оценка и управление факторами риска, оказывающими решающее влияние в современных условиях развития экономики России на результативность деятельности грузового транспорта.
9. Рейтинговые агентства и их роль в оценке риска.
10. Содержание, оценка и управление инфляционным риском.
11. Содержание, оценка и управление кредитным риском.
12. Содержание, оценка и управление валютным риском.
13. Современные механизмы управления риском.
14. Общие и специфические факторы оказывают решающее влияние в современных условиях развития экономики России на результативность:
 - а) производственного предпринимательства;
 - б) коммерческого бизнеса;
 - в) банковского дела;
 - г) инновационного процесса.

Тематика курсовых работ

- 1) Сущность и предпосылки экономического риска в рыночной экономике.
- 2) Цель и задачи исследования экономического риска.
- 3) Механизм и этапы исследования экономического риска.
- 4) Понятие и особенности предпринимательского и потребительского риска.
- 5) Функции предпринимательского риска.
- 6) Классификация экономических рисков по типу и отраслевой направленности предпринимательства.
- 7) Классификация экономических рисков по стадиям осуществления бизнес-идеи.
- 8) Классификация экономических рисков по степени (уровню) риска.
- 9) Классификация экономических рисков в зависимости от уровня их действия.
- 10) Систематические и несистематические риски: понятие, отличительные особенности, виды.
- 11) Основные факторы экономического риска в современном бизнесе.
- 12) Понятие и виды риска в производственном предпринимательстве.
- 13) Понятие и виды риска в коммерческом предпринимательстве.
- 14) Понятие и факторы риска в финансовом секторе экономики.
- 15) Понятие и факторы риска в инновационном предпринимательстве.
- 16) Основные критерии оценки экономического риска (Последствия и вероятности их наступления) и методические подходы к их измерению.
- 17) Виды и методические особенности оценки потерь, связанных с экономическим риском.
- 18) Сущность и границы основных зон экономического риска.
- 19) Статистические показатели абсолютной и относительной меры риска: среднее ожидаемое значение результата, среднее линейное и среднее квадратическое отклонение результата, коэффициент вариации.
- 20) Уравнение бюджетной линии: параметры, графическая интерпретация и возможности применения для распределения инвестиций между рисковыми и безрисковыми активами.
- 21) Факторный метод оценки экономического риска инвестиционных проектов.
- 22) Оценка риска на основе анализа финансового состояния фирмы.
- 23) Рейтинговые методы оценки степени риска.
- 24) Кривая Лоренца как метод оценки уровня экономического риска. Оценка риска по формуле профессора Маслова П.П.
- 25) Механизм нейтрализации экономического риска и основные его принципы.
- 26) Средства снижения экономического риска (избежание, передача, сохранения риска): сущность, способы реализации и взаимосвязь.
- 27) Информационное обеспечение как способ уменьшения экономического риска. Стоимость (ценность) информации.
- 28) Диверсификация как способ уменьшения риска: понятия, преимущества и границы применения.
- 29) Диверсификация производственной и коммерческой деятельности: возможности применения и оценка результативности.

- 30) Диверсификация финансовых активов: условия применения и оценка эффекта. Оптимизация «портфеля» финансовых активов.
- 31) Фонды рискованного финансирования.
- 32) Страхование как способ снижения риска. Критерии целесообразности страхования.
- 33) Хеджирование как способ ограничения риска операций с ценными бумагами.
- 34) Пути снижения внутренних предпринимательских рисков.
- 35) Отношение к риску и обоснование экономического поведения в условиях риска.
- 36) Механизм управления риском.

5.3. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств дисциплины "Управление рисками хозяйствующих субъектов" 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 "Управление рисками хозяйствующих субъектов" в полном объеме представлен в учебно-методическом комплексе дисциплины.

5.4. Перечень видов оценочных средств

Доклад, сообщение, реферат, собеседование, коллоквиум, тестовые задания, расчетные задания, устный опрос

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

Приступая к изучению дисциплины, обучающемуся необходимо внимательно ознакомиться с тематическим планом занятий, списком рекомендованной литературы.

При изучении дисциплины, обучающиеся выполняют следующие задания:

изучают рекомендованную научно-практическую и учебную литературу;

выполняют задания, предусмотренные для самостоятельной работы.

Основными видами аудиторной работы обучающихся являются лекции и семинарские занятия.

Уровень и глубина усвоения дисциплины зависят от активной и систематической работы на лекциях, изучения рекомендованной литературы, выполнения письменных заданий.

В ходе лекций преподаватель излагает и разъясняет основные, наиболее сложные понятия темы, а также связанные с ней теоретические и практические проблемы, дает рекомендации на семинарское занятие и указания на самостоятельную работу.

Семинарские занятия служат для закрепления изученного материала, развития умений и навыков подготовки докладов, сообщений, приобретения опыта устных публичных выступлений, ведения дискуссии, аргументации и защиты выдвигаемых положений, собеседования, а также для контроля преподавателем степени подготовленности обучающихся по изучаемой дисциплине в форме тестирования и решения задач.

Семинарские занятия предполагают свободный обмен мнениями по избранной тематике. Он начинается со вступительного слова преподавателя, формулирующего цель занятия и характеризующего его основную проблематику. Рассматриваются намеченные вопросы, поощряется выдвижение и обсуждение альтернативных мнений. В заключительном слове преподаватель подводит итоги обсуждения и объявляет

оценки обучающимся.

В целях контроля подготовленности обучающихся и привития им навыков краткого письменного изложения своих мыслей преподаватель в ходе семинарских занятий может осуществлять текущий контроль знаний в виде тестовых заданий и решения задач.

Самостоятельная работа обучающегося предполагает работу с научной и учебной литературой, написание рефератов (тема по выбору обучающегося):

При подготовке обучающиеся имеют возможность воспользоваться консультациями преподавателя. Кроме указанных тем обучающиеся вправе, по согласованию с преподавателем, избирать и другие интересующие их темы и написать по ним реферат.