

Факультет

Финансово-экономический

Кафедра

Финансов

"УТВЕРЖДАЮ"

Проректор

Л.Н. Костина

27.04.2024 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.05

"Управление рисками"

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

Квалификация

МАГИСТР

Форма обучения

ОЧНАЯ

Общая трудоемкость

4 З.Е.

Год начала подготовки по учебному плану

2024

Составитель(и):

канд. экон. наук, доцент

_____Афендикова Е.Ю.

Рецензент(ы):

канд. экон. наук, к доцент

_____Титиевская О.В.

Рабочая программа дисциплины "Управление 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. № 991)

Профиль "Финансы и кредит", утвержденного Ученым советом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС" от 27.04.2024 протокол № 12.

Срок действия программы: 2024-2026

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Финансов
Протокол от 01.04.2024 № 14

Заведующий кафедрой:

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

(подпись)

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

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2026 - 2027 учебном году на заседании кафедры Финансов

Протокол от " ____ " _____ 2026 г. № ____

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

(подпись)

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

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2027 - 2028 учебном году на заседании кафедры Финансов

Протокол от " ____ " _____ 2027 г. № ____

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

(подпись)

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

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для исполнения в 2028 - 2029 учебном году на заседании кафедры Финансов

Протокол от " ____ " _____ 2028 г. № ____

Зав. кафедрой д-р экон.наук, профессор, 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

идентификации рисков, присущих различным финансовым операциям;
определения концентрации финансовых рисков по направлениям финансовой деятельности;
мониторинга 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.О.05

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

Финансовая эконометрика

Финансовая безопасность

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

Преддипломная практика

1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:

ПКО ОС - ОУ.1: Демонстрирует знания по планированию, координированию и нормативному обеспечению интегрированной комплексной деятельности по управлению рисками в соответствии со стратегическими целями

Знать:

Уровень 1	Виды управленческих решений и методы их принятия.
Уровень 2	Классификацию рисков и их источники.
Уровень 3	Методы оценки рисков и их последствий.

Уметь:

Уровень 1	Использовать методы и инструменты управления рисками для принятия управленческих решений.
Уровень 2	Проводить оценку вариативных инвестиционных управленческих проектов.
Уровень 3	Владеть методами оценки результативности системы управления рисками.

Владеть:

Уровень 1	Методами идентификации и анализа рисков
Уровень 2	Методами оценки рисков и их последствий
Уровень 3	Методами управления рисками и их применение в различных проектах

В результате освоения дисциплины "Управление рисками" обучающийся должен:

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 рисками" видом промежуточной аттестации является Зачет с оценкой

РАЗДЕЛ 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

2.1. ТРУДОЕМКОСТЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоёмкость дисциплины "Управление рисками" 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	Компетен- ции	Литература	Инте- ракт.	Примечание
Раздел 1. Теоретические аспекты финансово-экономических рисков						
Тема 1.1. Экономическая сущность и классификация финансовых рисков /Лек/	2	4	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.1. Экономическая сущность и классификация финансовых рисков /Сем зан/	2	2	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.1. Экономическая сущность и классификация финансовых рисков /Ср/	2	6	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.2. Количественная оценка риска /Лек/	2	6	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.2. Количественная оценка риска /Сем зан/	2	2	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.2. Количественная оценка риска /Ср/	2	6	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.3. Стратегия и тактика управления финансовым риском /Лек/	2	4	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	

Тема 1.3. Стратегия и тактика управления финансовым риском /Сем зан/	2	2	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.3. Стратегия и тактика управления финансовым риском /Ср/	2	6	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.4. Факторы, детерминирующие эффективность управления финансовыми рисками /Лек/	2	2	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.4. Факторы, детерминирующие эффективность управления финансовыми рисками /Сем зан/	2	2	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.4. Факторы, детерминирующие эффективность управления финансовыми рисками /Ср/	2	7	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Раздел 2. Практические основы управления финансово-экономическими рисками						
Тема 2.1. Управление рисками в производственном комплексе /Лек/	2	2	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.1. Управление рисками в производственном комплексе /Сем зан/	2	4	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.1. Управление рисками в производственном комплексе /Ср/	2	7	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.2. Принятие решений в условиях неопределенности риска /Лек/	2	2	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.2. Принятие решений в условиях неопределенности риска /Сем зан/	2	2	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.2. Принятие решений в условиях неопределенности риска /Ср/	2	7	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	

Тема 2.3. Способы и методы управления экономическими рисками /Лек/	2	4	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.3. Способы и методы управления экономическими рисками /Сем зан/	2	4	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.3. Способы и методы управления экономическими рисками /Ср/	2	7	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.4. Риски невостребованной продукции: внешние, внутренние причины, их анализ /Лек/	2	2	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.4. Риски невостребованной продукции: внешние, внутренние причины, их анализ /Сем зан/	2	4	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.4. Риски невостребованной продукции: внешние, внутренние причины, их анализ /Ср/	2	7	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Раздел 3. Финансовые риски в государственном (муниципальном) секторе						
Тема 3.1. Риск и его роль в управлении государственными (муниципальными) финансами /Лек/	2	2	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.1. Риск и его роль в управлении государственными (муниципальными) финансами /Сем зан/	2	4	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.1. Риск и его роль в управлении государственными (муниципальными) финансами /Ср/	2	7	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.2. Классификация финансовых рисков в государственном (муниципальном) секторе /Лек/	2	2	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.2. Классификация финансовых рисков в государственном (муниципальном) секторе /Сем зан/	2	4	ПКo OC - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	

Тема 3.2. Классификация финансовых рисков в государственном (муниципальном) секторе /Ср/	2	7	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.2. Классификация финансовых рисков в государственном (муниципальном) секторе /Конс/	2	2	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.3. Оценка финансовых рисков в государственном (муниципальном) секторе /Лек/	2	2	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.3. Оценка финансовых рисков в государственном (муниципальном) секторе /Сем зан/	2	2	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.3. Оценка финансовых рисков в государственном (муниципальном) секторе /Ср/	2	7	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.4. Риск-ориентированные управленческие подходы в государственном управлении /Лек/	2	0	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.4. Риск-ориентированные управленческие подходы в государственном управлении /Сем зан/	2	0	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.4. Риск-ориентированные управленческие подходы в государственном управлении /Ср/	2	0	ПКо ОС - ОУ.1	Л1.1Л1.2Л2.1 Л3.1 Л3.2 Л3.3 Э1 Э2 Э3	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	Е.Ю. Афендикова	Управление финансово-экономическими рисками, конспект лекций для обучающихся 2 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (профили: «Финансы и кредит», «Финансы государственного сектора») очной формы обучения	Донецк : ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС", 2024
Л1.2	Е.Ю. Афендикова	Управление рисками, конспект лекций для обучающихся 1 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08. Финансы и кредит, профили «Финансы и кредит», «Финансы государственного сектора», «Налоги и налогообложение» очной формы обучения	Донецк : ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС", 2024
2. Дополнительная литература			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	А.Р. Эмексузян, К.В. Балдин, А.Т. Алиев, О.С. Суртаева	Управление рисками и антикризисная политика: монография (169 с)	Сыктывкар: ГОУ ВО КРАГСиУ, 2022
3. Методические разработки			
	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
ЛЗ.1	Е.Ю. Афендикова	Управление рисками: методические рекомендации для проведения семинарских занятий для обучающихся 1 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (профиль «Финансы и кредит») (35 с.)	ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС», 2024
ЛЗ.2	Е.Ю. Афендикова	Управление рисками: методические рекомендации для проведения семинарских занятий для обучающихся 1 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (профиль «Финансы и кредит») (35 с.)	ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС», 2024
ЛЗ.3	Е.Ю. Афендикова	Управление рисками: методические рекомендации по организации самостоятельной работы для обучающихся 1 курса образовательной программы магистратуры направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит (профиль «Финансы и кредит») (17 с.)	ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС», 2024
4.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"			
Э1	Центральный банк Российской Федерации		https://cbr.ru/
Э2	Министерство экономического развития РФ		https://www.economy.gov.ru/
Э3	Министерство финансов РФ		https://minfin.gov.ru/
4.3. Перечень программного обеспечения			
Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства: Moodle, Программное обеспечение: - Libre Office (лицензия Mozilla Public License v2.0.) - 7-Zip (лицензия GNU Lesser General Public License) - AIMP (лицензия LGPL v.2.1)			

- STDU Viewer (freeware for private non-commercial or educational use)
- GIMP (лицензия GNU General Public License)
- Inkscape (лицензия GNU General Public License)
- MariaDB (лицензия GNU General Public License)
- Visual Studio Code (лицензия MIT License)
- Python (лицензия Software Foundation License)
- PHP (лицензия Berkeley Software Distribution Licenses).

4.4. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

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>

Лань электронно-библиотечная система – <https://e.lanbook.com/?ref=dtf.ru%2F>

Электронно-библиотечная система Znanium - <https://znanium.ru/>

4.5. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебная аудитория для проведения учебных занятий, предусмотренных образовательной программой

- рабочее место преподавателя,
- посадочные места по количеству обучающихся - 64;
- комплект учебной мебели (парты) – 34;
- комплект учебной мебели (стулья) – 64
- доска меловая;
- интерактивная панель;

Помещение для самостоятельной работы

Для самостоятельной работы обучающихся предусмотрены специальные помещения, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» с обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС».

- рабочих мест по количеству обучающихся - 16;
- комплект учебной мебели (столы, компьютерные столы, стулья, шкафы);
- журнал регистрации вводного и периодического инструктажей обучающихся по технике безопасности.

Технические средства обучения:

- 16 компьютеров (Intel Core i7-10700, 8 Cores, 2,9 GHz, 16 Gb ОЗУ) с выходом в сеть Интернет;

Программное обеспечение:

- Libre Office (лицензия Mozilla Public License v2.0.)
- 7-Zip (лицензия GNU Lesser General Public License)
- AIMP (лицензия LGPL v.2.1)
- STDU Viewer (freeware for private non-commercial or educational use)
- GIMP (лицензия GNU General Public License)
- Inkscape (лицензия GNU General Public License)
- MariaDB (лицензия GNU General Public License)
- Visual Studio Code (лицензия MIT License)
- Python (лицензия Software Foundation License)
- PHP (лицензия Berkeley Software Distribution Licenses).

РАЗДЕЛ 5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

5.1. Контрольные вопросы и задания

Вопросы к зачету с оценкой:

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 рисковой 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 рисками» представлен в виде комплекта оценочных материалов.

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.

При возникновении сложностей по усвоению программного материала необходимо посещать консультации по учебной дисциплине, задавать уточняющие вопросы на лекциях и семинарских занятиях.