

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Костина Лариса Николаевна  
Должность: проректор  
Дата подписания: 27.04.2024 г. 12:19  
Уникальный программный ключ:  
1800f7d89cf4ea7507265ba593fe87537eb15a6c

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

**Факультет**

**Финансово-экономический**

**Кафедра**

**Финансов**

**"УТВЕРЖДАЮ"**

Проректор

\_\_\_\_\_ Л.Н. Костина

27.04.2024 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

**Б1.В.20**

**"Теория и практика управления финансовыми  
рисками"**

**Направление подготовки 38.03.01 Экономика**  
**Профиль "Финансы и кредит"**

Квалификация

*бакалавр*

Форма обучения

*очно-заочная*

Общая трудоемкость

*5 з.е.*

Год начала подготовки по учебному плану

*2024*

Донецк  
2024

Составитель(и):

канд. экон. наук, доцент

\_\_\_\_\_ Е.Ю. Афендикова

Рецензент(ы):

канд. экон. наук, доцент

\_\_\_\_\_ О.В. Титиевская

Рабочая программа дисциплины (модуля) "Теория и практика управления финансовыми рисками" разработана в соответствии с:

Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954)

Образовательным стандартом по направлению подготовки высшего образования 38.03.01 Экономика (приказ ФГБОУ ВО «РАНХиГС» от 07.09.2023 г. № 01-24612).

Рабочая программа дисциплины (модуля) составлена на основании учебного плана Направление подготовки 38.03.01 Экономика, профиль "Финансы и кредит", утвержденного Ученым советом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС" от 27.04.2024 протокол № 12.

Срок действия программы: 2024-2029

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры Финансов

Протокол от 01.05.2024 № 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

<b>1.1. ЦЕЛИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
Приобретение обучающимися знаний и умений в области управления финансовыми рисками.	
<b>1.2. УЧЕБНЫЕ ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ</b>	
Задачи дисциплины: изучение теоретических и методологических основ управления финансовыми рисками; изучение теоретических и практических основ разработки, внедрения и контроля системы управления финансовыми рисками.	
<b>1.3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОСНОВНОЙ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ</b>	
Цикл (раздел) ОПОП ВО:	<u>Б1.В.20</u>
<i>1.3.1. Дисциплина "Теория и практика управления финансовыми рисками" опирается на следующие элементы ОПОП ВО:</i>	
Инвестиции	
Финансы организаций	
Финансы	
<i>1.3.2. Дисциплина "Теория и практика управления финансовыми рисками" выступает опорой для следующих элементов:</i>	
Комплексный анализ финансовой деятельности	
Бюджетная система	
Финансовое планирование и прогнозирование	
<b>1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:</b>	
<i>ПКс – 2.1: Управляет рисками с использованием инструментов риск-менеджмента, а также выбирает оптимальные способы снижения конкретных рисков</i>	
Знать:	
<b>Уровень 1</b>	Инструменты и методики анализа рисков.
<b>Уровень 2</b>	Методы оценки и управления рисками.
<b>Уровень 3</b>	Стратегии и тактики снижения рисков.
Уметь:	
<b>Уровень 1</b>	Идентифицировать и классифицировать риски.
<b>Уровень 2</b>	Использовать методы анализа и оценки рисков.
<b>Уровень 3</b>	Разрабатывать стратегии и планы по снижению рисков.
Владеть:	
<b>Уровень 1</b>	Методами теории и практики управления финансовыми рисками.
<b>Уровень 2</b>	Методами использования инструментов риск-менеджмента.
<b>Уровень 3</b>	Методами способов снижения конкретных рисков.
<b>1.4. РЕЗУЛЬТАТЫ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ:</b>	
<i>ПКс – 2.2: Применяет методологию риск-менеджмента для формирования корпоративной стратегии, политики и тактики управления рисками</i>	
Знать:	
<b>Уровень 1</b>	Основные принципы управления рисками.
<b>Уровень 2</b>	Виды управления рисками.
<b>Уровень 3</b>	Систему управления рисками.
Уметь:	
<b>Уровень 1</b>	Определять и классифицировать риски.
<b>Уровень 2</b>	Использовать методы анализа и оценки рисков.
<b>Уровень 3</b>	Применять инструменты риск-менеджмента для управления рисками.

Владеть:	
<b>Уровень 1</b>	Финансово-экономическими навыками при осуществлении своей профессиональной деятельности.
<b>Уровень 2</b>	Методами риск-менеджмента
<b>Уровень 3</b>	Методами управления рисками

**В результате освоения дисциплины "Теория и практика управления финансовыми рисками"**

<b>3.1</b>	<b>Знать:</b>
	Сущность управления финансовыми рисками.
	Методы, техники, технологии, программные средства и информационные базы идентификации различных видов риска.
	Современные инструменты, позволяющие выявлять, фиксировать и идентифицировать риски применения финансовых технологий.
<b>3.2</b>	<b>Уметь:</b>
	Проводить экономические и финансовые расчеты относительно реальных рисков и разработка рекомендаций по их минимизации.
	Использовать современные инструменты, позволяющие выявлять, фиксировать и идентифицировать риски применения финансовых технологий.
	Идентифицировать и анализировать изменения рисков в динамике.
<b>3.3</b>	<b>Владеть:</b>
	Владеть различными источниками информации для проведения финансово-экономических расчетов и обоснования принимаемых управленческих решений.
	Современными инструментами, позволяющими выявлять, фиксировать и идентифицировать риски применения финансовых технологий, а также выполнять их мониторинг в целях нейтрализации и минимизации ущерба.
	Методами анализа и оценки рисков деятельности организаций, в том числе финансово-кредитных и предлагает решения по их минимизации в контексте достижения финансовой стабильности, методами применения финансовых инструментов для минимизации потерь финансово-кредитных институтов.

**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 локальным нормативным актом. По дисциплине "Теория и практика управления финансовыми рисками" видом промежуточной аттестации является Экзамен

**РАЗДЕЛ 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

**2.1. ТРУДОЕМКОСТЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ**

Общая трудоёмкость дисциплины "Теория и практика управления финансовыми рисками" составляет 5 зачётные единицы, 180 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
<b>Раздел 1. ТЕОРЕТИКО-МЕТОДИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ УПРАВЛЕНИЯ ФИНАНСОВЫМИ РИСКАМИ</b>						

Тема 1.1 Экономическая сущность и классификация финансовых рисков предприятия /Лек/	7	4	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.1 Экономическая сущность и классификация финансовых рисков предприятия /Сем зан/	7	8	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.1 Экономическая сущность и классификация финансовых рисков предприятия /Ср/	7	7	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.2 Управление инвестиционными рисками /Лек/	7	4	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.2 Управление инвестиционными рисками /Сем зан/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.2 Управление инвестиционными рисками /Ср/	7	7	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.3. Риск неплатежеспособности субъектов хозяйствования /Сем зан/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 1.3. Риск неплатежеспособности субъектов хозяйствования /Ср/	7	7	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
<b>Раздел 2. УПРАВЛЕНИЕ ВАЛЮТНЫМИ И КРЕДИТНЫМИ РИСКАМИ В СИСТЕМЕ ФИНАНСОВЫХ ОТНОШЕНИЙ</b>						
Тема 2.1. Валютные риски субъектов хозяйствования: методы анализа и управления /Лек/	7	4	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.1. Валютные риски субъектов хозяйствования: методы анализа и управления /Сем зан/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.1. Валютные риски субъектов хозяйствования: методы анализа и управления /Ср/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	

Тема 2.2 Кредитный риск в системе финансовых отношений /Лек/	7	4	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.2 Кредитный риск в системе финансовых отношений /Сем зан/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 2.2 Кредитный риск в системе финансовых отношений /Ср/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
<b>Раздел 3. МЕХАНИЗМЫ НЕЙТРАЛИЗАЦИИ ФИНАНСОВЫХ РИСКОВ И ИХ ЭФФЕКТИВНОСТЬ</b>						
Тема 3.1 Формы и виды страхования финансовых рисков /Лек/	7	4	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.1 Формы и виды страхования финансовых рисков /Сем зан/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.1 Формы и виды страхования финансовых рисков /Ср/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.2 Методы оценки степени риска /Лек/	7	4	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.2 Методы оценки степени риска /Сем зан/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.2 Методы оценки степени риска /Ср/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.3 Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков /Лек/	7	2	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 3.3 Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков /Сем зан/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	

Тема 3.3 Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков /Ср/	7	10	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
<b>Раздел 4. ЦИФРОВЫЕ РИСКИ</b>						
Тема 4.1 Риски цифровой экономики и технологии контроля на микро- и макроуровне /Лек/	7	2	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 4.1 Риски цифровой экономики и технологии контроля на микро- и макроуровне /Сем зан/	7	6	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Тема 4.1 Риски цифровой экономики и технологии контроля на микро- и макроуровне /Ср/	7	12	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	
Консультация. Формы и виды страхования финансовых рисков /Конс/	7	2	ПКс – 2.1 ПКс – 2.2	Л1.1 Л2.1Л3. 1 Л3.2 Л3.3 Л3.4 Э1 Э2 Э3	0	

### РАЗДЕЛ 3. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

3.1 В процессе освоения дисциплины "Теория и практика управления финансовыми рисками" используются следующие образовательные технологии: лекции (Л), практические занятия (ПР), самостоятельная работа студентов (СР) по выполнению различных видов заданий.

3.2 В процессе освоения дисциплины "Теория и практика управления финансовыми рисками" используются следующие интерактивные образовательные технологии: проблемная лекция (ПЛ). Лекционный материал представлен в виде слайд-презентации в формате «Power Point». Для наглядности используются материалы различных научных и технических экспериментов, 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, эссе, презентации, эмпирического исследования.



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

### 4.1. Рекомендуемая литература

#### 1. Основная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Н.А. Пименов	Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности. Учебник и практикум для вузов (353 с.)	Москва:Издательство Юрайт., 2024

#### 2. Дополнительная литература

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Е.Ю. Афендикова	Теория и практика управления финансовыми рисками. Учебно-методическое пособие (165 с.)	Донецк : ГОУ ВПО «ДОНАУИГС», 2021.

#### 3. Методические разработки

	Авторы,	Заглавие	Издательство, год
Л3.1	Е.Ю. Афендикова	Теория и практика управления финансовыми рисками: методические рекомендации по выполнению индивидуального задания для обучающихся 4 курса образовательной программы бакалавриата направления подготовки 38.03.01 Экономика (профиль «Финансы и кредит») всех форм обучения (19 с.)	Донецк :ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС» 2024
Л3.2	Е.Ю. Афендикова	Теория и практика управления финансовыми рисками: методические рекомендации для проведения семинарских занятий для обучающихся 4 курса образовательной программы бакалавриата направления подготовки 38.03.01 Экономика (профиль «Финансы и кредит») всех форм обучения (35 с.)	Донецк :ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС» 2024
Л3.3	Е.Ю. Афендикова	Теория и практика управления финансовыми рисками: методические рекомендации по организации самостоятельной работы для обучающихся 4 курса образовательной программы бакалавриата направления подготовки 38.03.01 Экономика (профиль «Финансы и кредит») всех форм обучения (17 с.)	Донецк :ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС» 2024
Л3.4	Е.Ю. Афендикова	Теория и практика управления финансовыми рисками: методические рекомендации по курсовой работе для обучающихся 4 курса образовательной программы бакалавриата направления подготовки 38.03.01 Экономика (профиль «Финансы и кредит») всех форм обучения (17 с.)	Донецк :ФГБОУ ВО «ДОНАУИГС» 2024

### 4.2. Перечень ресурсов

#### информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"

Э1	Электронный каталог изданий ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС"	<a href="http://unilib.dsum.internal/">http://unilib.dsum.internal/</a>
Э2	Научная электронная библиотека «КИБЕРЛЕНИНКА»	<a href="https://cyberleninka.ru/">https://cyberleninka.ru/</a>
Э3	Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU eLIBRARY.RU	<a href="http://elibrary.ru/defaultx.asp">http://elibrary.ru/defaultx.asp</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 копусе ПК) Windows 8.1 Professional x86/64 (академическая подписка DreamSpark Premium), LibreOffice 4.3.2.2 (лицензия GNU LGPL v3+ и MPL2.0) Google Chrome, Mozilla

#### 4.4. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Moodle,

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

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

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

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

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

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

Электронная библиотека федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования "Уральский государственный экономический университет"

<https://www.usue.ru/studentam/biblioteka/>

#### 4.5. Материально-техническое обеспечение дисциплины

1. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, семинарского типа, текущего контроля, групповых консультаций, индивидуальных консультаций по написанию курсовых работ и промежуточной аттестации: аудитория № 301 учебный корпус № 2 г. Донецк, пр. Богдана Хмельницкого, 108 (ФГБОУ ВО «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).

2. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, текущего контроля, групповых консультаций и промежуточной аттестации: аудитория №416 учебный корпус №6 г. Донецк, ул. Артема, 94 (ГОУ ВПО «ДОНАУИГС»): специализированная мебель: рабочее место преподавателя, рабочие места обучающихся (15), стационарная

доска, демонстрационные плакаты, Windows 8.1 Professional x86/64 (академическая подписка DreamSpark Premium), LibreOffice 4.3.2.2 (лицензия GNU LGPL v3+ и MPL2.0).

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

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

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

Сервер: 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), 1С ERP УП, 1С 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 на экзамен:

1. Какие признаки могут быть положены в основу классификации рисков в экономической системе?
2. Назовите главные классы рисков.
3. Какие основные виды инвестиционных рисков вы знаете?
4. Дайте краткую характеристику кредитных рисков.
5. Охарактеризуйте предпринимательские риски.
6. Назовите основные особенности рисков стран и дайте их характеристику.

7. Охарактеризуйте понятие «риск ликвидности».
8. Какие риски называют страховыми? Сформулируйте критерии страхования рисков.
9. Какова цель риск-менеджмента?
10. Назовите основные этапы риск-менеджмента, объясните их содержание, определите цель.
11. Дайте определение категории «инвестиционный риск».
12. Как связаны ожидаемая доходность и риск инвестиционного проекта?
13. Охарактеризуйте методы учета неопределенности и оценки рисков инвестиционных проектов.
14. Что такое ставка дисконта для собственного капитала инвестиционного проекта? Как она связана с уровнем риска проекта?
15. Каким образом риски инвестиционных проектов могут быть учтены в составе ставки дисконта?
16. Что такое модель оценки капитальных активов? Каким образом в ней учтены риски инвестиционного проекта?
17. Назовите виды страхования инвестиционных рисков.
18. Какие альтернативные методы применяют для защиты от инвестиционных рисков?
19. Определите суть отраслевого риска.
20. Охарактеризуйте методические подходы к оптимальному решению.
21. В чем заключается риск неплатежеспособности предприятий.
22. Какие методы анализа риска неплатежеспособности предприятия.
23. Каким образом осуществляют коэффициентный анализ.
24. Объясните сущность метода анализа целесообразности затрат.
25. В чем заключается сущность модели Альтмана.
26. Как провести анализ риска неплатежеспособности предприятия по модели Тоффлера.
27. Типы валютных рисков.
28. Способы страхования валютных рисков.
29. Валютный опцион.
30. Форвардные валютные сделки.
31. Валютные фьючерсы.
32. Особенности управления кредитными рисками.
33. Использование обеспечения на основе рейтингового подхода.
34. Углубленный мониторинг состояния заемщиков.
35. Методика определения группы кредитного риска.
36. Анализ финансовых отчетов заемщика.

## 5.2. Темы письменных работ

Примерный список тем курсовых работ:

1. Управление финансовой результативностью предприятия в условиях неопределенности и риска
2. Особенности принятия стратегических решений в условиях неопределенности и риска
3. Особенности использования методов оценки риска в проблеме реализации целей и задач финансового менеджмента на примере непризнанных республик.
4. Особенности управления финансовыми рисками при государственном инвестировании
5. Особенности использования методов управления финансовыми рисками, связанными со страхованием различных видов деятельности на примере непризнанных республик.
6. Анализ основных определений финансового риска и особенности их использования при формировании стратегий управления финансовым риском в отрасли.
7. Формирование стратегий управления финансовым риском компании с учетом принятых определений финансового риска и особенностей их использования в данной отрасли.
8. Анализ основных определений финансового риска и особенности их использования при формировании стратегий управления финансовым риском при осуществлении финансовых операций.
9. Формировании тактики управления финансовым риском в отрасли на основе применения обоснованной системы показателей финансового риска.
10. Анализ основных определений финансового риска и особенности их использования при формировании тактики управления финансовым риском в конкретной компании.
11. Анализ основных определений финансового риска и особенности их использования при формировании тактики управления финансовым риском при осуществлении финансовых операций.
12. Особенности использования показателей финансового риска при формировании оперативного управления финансовым риском.
13. Основные принципы управления финансовым риском на основе использования математических моделей оценки риска.
14. Роль и место методов оценки риска в проблеме реализации целей и задач финансового менеджмента.
15. Учет специфики проявления противоречивости, альтернативности, неопределенности финансового риска при выработке стратегий управления им.

16. Основные причины неопределенности финансового риска (источники риска) на уровне отрасли и способы его минимизации.
17. Основные причины неопределенности финансового риска (источники риска) на уровне предприятия (фирмы) и способы его минимизации.
18. Основные причины неопределенности финансового риска (источники риска) на уровне проведения финансовой операции и способы его минимизации.
19. Влияние принципов классификация финансовых рисков на методы и способы управления им.
20. Сравнительный анализ основных методов управления финансовыми рисками.
21. Управление финансовыми рисками, связанными со страхованием финансовых операций.
22. Управление финансовыми рисками, связанными со страхованием недвижимости.
23. Общие методы управления финансовыми рисками, связанными со страхованием различных видов деятельности.
24. Учет показателей страхового риска при управлении финансовыми рисками.
25. Валютный риск и основные методы и способы управления им.
26. Управление финансовыми рисками, связанными с действующей налоговой политикой.
27. Специфика управления финансовыми рисками форс-мажорных обстоятельств.
28. Методы управления финансовыми рисками при реализации инвестиционных проектов.
29. Риски финансового инвестирования.
30. Управление финансовыми рисками при государственном инвестировании.
31. Управление финансовыми рисками при частном инвестировании.
32. Специфика управления финансовыми рисками иностранного и совместного инвестирования.
33. Управление финансовыми рисками краткосрочного инвестирования.
34. Управление финансовыми рисками долгосрочного инвестирования.
35. Управление инфляционным риском при реализации инвестиционных проектов.
36. Управление дефляционным риском при реализации инвестиционных проектов.
37. Управление операционным финансовым риском при реализации инвестиционных проектов.
38. Управление кредитным инвестиционным риском с позиций кредитора.
39. Управление кредитным инвестиционным риском с позиций заемщика.
40. Анализ финансовых рисков инвестиционного проекта и определение методов и способов управления им.
41. Управление финансовыми рисками с использованием механизмов его диверсификации.
42. Диверсификация финансовых вложений как основной механизм минимизации финансовых рисков.
43. Социально – психологические аспекты оценки и анализа риска при принятии управленческих решений в области управления финансовыми рисками.
44. Основные определения ущерба в области финансовой деятельности и их использование в процессе выработки управленческих решений по минимизации финансового риска.
45. Общие принципы оценки эффективности инвестиционных проектов на основе использования показателей финансового риска.
46. Методы прогнозирования стоимости инвестиционных ресурсов в условиях инфляции и их использование при формировании стратегии управления финансовыми рисками.
47. Основные положения теории оптимальных решений в области финансовых рисков.
48. Статистический анализ финансовых рисков и их использование при формировании стратегий управления финансовыми рисками.
49. Использование методов оценки финансового риска при определении необходимости перестрахования рисков.
50. Франчайзинг как форма объединения, направленная на минимизацию финансового риска.
51. Управление финансовыми рисками на рынке обращения ценных бумаг.
52. Управление финансовыми рисками на основе использования процедур хеджирования.
53. Управление финансовыми рисками на основе использования процедур лимитирования.
54. Управление финансовыми рисками на основе использования опционов.
55. Управление финансовыми рисками инвестиционного проекта на основе использования игровых методов.

### 5.3. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств дисциплины "Теория и практика управления финансовыми рисками" разработан в соответствии с локальным нормативным актом ФГБОУ ВО "ДОНАУИГС".

Фонд оценочных средств дисциплины "Теория и практика управления финансовыми рисками" в полном объеме представлен в виде приложения к данному РПД.

### 5.4. Перечень видов оценочных средств

Текущий контроль представлен в виде текущего устного /письменного опроса, докладов, ситуационных заданий, тестовых заданий.

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

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

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

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

- для лиц с нарушениями зрения: учебно-методические материалы в печатной форме увеличенным шрифтом; в форме электронного документа; в форме аудиофайла (перевод учебных материалов в аудиоформат); индивидуальные задания и консультации.

- для лиц с нарушениями слуха: учебно-методические материалы в печатной форме; в форме электронного документа; видеоматериалы с субтитрами; индивидуальные консультации с привлечением сурдопереводчика; индивидуальные задания и консультации.

- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата: учебно-методические материалы в печатной форме; в форме электронного документа; в форме аудиофайла; индивидуальные задания и консультации.

## **РАЗДЕЛ 7. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО УСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ**

Обучающемуся рекомендуется не ограничиваться при изучении темы только основной литературой, необходимо конспектировать лекции, изучать методические рекомендации, издаваемые кафедрой. Для улучшения качества освоения материала необходимо в день лекции повторно изучить сделанный на занятиях конспект, повторить новые понятия, составить структурно-логическую схему лекции.

Усвоение дисциплины требует освоения методов оценки и анализа корпоративных рисков, 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.