Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 08.11.2026 17:55:05
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7224a676a27f1b2

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ «ДОНЕЦКИЙ НАЦИОНАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ЭКОНОМИКИ И ТОРГОВЛИ ИМЕНИ МИХАИЛА ТУГАН-БАРАНОВСКОГО»

КАФЕДРА ФИНАНСОВ И ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ

УТВЕРЖДАЮ:
Проректор по учебно-методической работе

_____ Л. В. Крылова
(подпись) (инициалы, фамилия)
«28» 02 2024 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Б.1.В.ДВ.03.01 МОДЕЛИРОВАНИЕ И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ

(название учебной дисциплины)

Укрупненная группа специальностей 38.00.00 Экономика и управление
(код, наименование)

Программа высшего образования – программа специалитета

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность
(код, наименование)

Специализация: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Институт учета и финансов

Форма обучения, курс:
очная форма обучения, 5 курс
заочная форма обучения, 6 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Донецк
2024

Рабочая программа учебной дисциплины «Моделирование и управление рисками экономической деятельности» для обучающихся по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, Специализация: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности, разработанная в соответствии с учебным планом, утвержденным Ученым советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»:
- в 2024г. - для очной формы обучения;
- в 2024г. - для заочной формы обучения;

Разработчик: Малецкий Антон Викторович, доцент кафедры финансов и экономической безопасности, кандидат экономических наук, доцент

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры финансов и экономической безопасности
Протокол от «_21_» ____02_____ 2024 года № __21_
Зав. кафедрой финансов и экономической безопасности

_____ Л. А. Омельянович
(подпись) (инициалы, фамилия)

СОГЛАСОВАНО:
. директора Института учета и финансов

_____ Л.И. Тымчина
(подпись) (инициалы, фамилия)

«_24_» ____02_____ 2024 года

ОДОБРЕНО
Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»
Протокол от «_28_» ____02_____ 2024 года № _7_

Председатель_____ Л. В. Крылова
(подпись) (инициалы, фамилия)

© Малецкий А.В., 2024 год
© Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2024 год

1. ОПИСАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

<table>
<tr><td rowspan="2">Наименование показателя</td><td rowspan="2">Наименование укрупненной группы направлений подготовки / специальностей, направление подготовки / специальность, профиль / магистерская программа / специализация, программа высшего образования</td><td colspan="2">Характеристика учебной дисциплины</td></tr>
<tr><td>очная форма обучения</td><td>заочная форма обучения</td></tr>
<tr><td>Количество зачетных единиц – 3</td><td>Укрупненная группа специальностей 38.00.00 Экономика и управление</td><td colspan="2">Базовая</td></tr>
<tr><td>Модулей – 1</td><td rowspan="5">Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность</td><td colspan="2">Год подготовки:</td></tr>
<tr><td>Смысловых модулей – 3</td><td>5-й</td><td>6-й</td></tr>
<tr><td rowspan="3">Общее количество часов – 108</td><td colspan="2">Семестр:</td></tr>
<tr><td>9-й</td><td>Зимняя сессия</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лекции</td></tr>
<tr><td rowspan="11">Количество часов в неделю для очной формы обучения:
аудиторных – 3
самостоятельной работы обучающегося – 5</td><td rowspan="11">Программа высшего образования – программа специалитета</td><td>18 час.</td><td>8 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Практические, семинарские занятия</td></tr>
<tr><td>16 час.</td><td>6 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лабораторные работы</td></tr>
<tr><td>-</td><td>-</td></tr>
<tr><td colspan="2">Самостоятельная работа</td></tr>
<tr><td>72,85 час.</td><td>90,55 час.</td></tr>
<tr><td colspan="2">Индивидуальные задания[1]:</td></tr>
<tr><td>3 ТМК, КР (0,9 часа)</td><td>3 ТМК, КР (3,45 часа)</td></tr>
<tr><td colspan="2">Форма промежуточной аттестации:</td></tr>
<tr><td>зачёт (0,25 час.)</td><td>зачёт (0,25 час.)</td></tr>
</table>

* для очной формы обучения указывается количество проводимых текущих модульных контролей (например, 2ТМК), при наличии – курсовая работа/проект (КР/КП)

для заочной формы обучения указывается, при наличии, аудиторная письменная работа/контрольная работа (АПР), курсовая работа/проект (КР/КП)

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:
для очной формы обучения – 34 / 72,85
для заочной формы обучения – 18 / 86,25

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель: изучить сущность и становление системы исследования финансовых рисков: финансовая среда предпринимательства и тенденции развития исследования финансовых рисков мирового хозяйства; различные подходы и классификационные схемы предпринимательских рисков мирового хозяйства; функции и способов оценки предпринимательских рисков, с акцентированием внимания на финансовых рисках. При этом анализируются финансово-кредитные и валютные риски, как составляющие предпринимательских рисков. Методы снижения финансовых рисков.

Задачи: изучение основ управления предпринимательскими рисками предприятия; принятие решений в рисковых ситуациях рынка; овладение методами управления предпринимательскими рисками предприятия; формирование политики управления капиталом с учётом совокупности предпринимательских рисков.

3.МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВПО

Дисциплина «Моделирование и управление рисками экономической деятельности» относится к вариативной части профессионального цикла (Б1.В.ДВ.03.01) ОПОП ВО.

Изучение данной учебной дисциплины базируется на знаниях таких учебных дисциплин: «Деньги, кредит, банки», «Финансы», «Финансы предприятий», «Экономическая безопасность», «Планирование и прогнозирование».

Учебная дисциплина является основополагающей для освоения дисциплин «Финансовая глобализация», «Стратегическое обеспечение финансово-экономической безопасности», «Финансовая безопасность», готовности к преддипломной практике.

4. ПЕРЕЧЕНЬ ПЛАНИРУЕМЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ), СООТНЕСЕННЫХ С ПЛАНИРУЕМЫМИ РЕЗУЛЬТАТАМИ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

В результате освоения изучения учебной дисциплины у обучающегося должны быть сформированы компетенции и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
ПК-1 Способен осуществлять эксплуатацию интегрированной системы управления рисками.	ИД-1$_{ПК-1}$ Анализирует функционирование системы управления рисками ИД-2$_{ПК-1}$ Осуществляет выработку рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками

В результате изучения учебной дисциплины обучающийся должен:

знать: - основные термины и понятия дисциплины; основные виды рисков, их особенности; методы и модели анализа финансовых рисков.

уметь: применять знания, полученные при изучении дисциплины, для принятия решений связанных с производственными и иными финансовыми рисками при работе с анализируемыми данными; оценивать доходность и риск ценных бумаг и иных финансовых инструментов, а также знать способы уменьшения риска.

владеть: фундаментальными знаний по теории рынка ценных бумаг; фундаментальными знаниями по теории менеджмента и управления рисками; практическими навыками для принятия управленческих решений в ситуациях связанных с управлением и оценкой экономических рисков; владеть знаниями финансовых инструментов.

5. ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. Моделирование и управление рисками экономической деятельности

Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков

Тема 1. Сущность, содержание и виды риска

Тема 2. Риск в инвестировании капитала

Смысловой модуль 2. Моделирование и оценка финансовых рисков

Тема 3. Финансовое прогнозирование на основе линейных регрессионных моделей

Тема 4. Оценка предпринимательских рисков

Тема 5. Экспертный метод анализа риска

Тема 6. Анализ риска методом имитационного моделирования Монте-Карло

Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска

Тема 7. Страхование – основной прием риск – менеджмента

Тема 8. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и риска

Тема 9. Запасы и резервы как способы снижения риска

6. СТРУКТУРА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Названия смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма обучения						заочная форма обучения					
	Всего	в том числе*					Всего	в том числе*				
		л[1]	п[2]	лаб[3]	инд[4]	СРС[5]		л[1]	п[2]	лаб[3]	инд[4]	СРС[5]
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Модуль 1. Моделирование и управление рисками экономической деятельности												
Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков												
Тема 1. Сущность, содержание и виды риска	11	2	1	-	-	8	11	0,5	0,5	-	-	10
Тема 2. Риск в инвестировании капитала	11	2	1	-	-	8	11	0,5	0,5	-	-	10
Итого по смысловому модулю 1	22	4	2	-	-	16	22	1	1	-	-	20
Смысловой модуль 2. Моделирование и оценка финансовых рисков												
Тема 3. Финансовое прогнозирование на основе линейных регрессионных моделей	12	2	2	-	-	8	12	1	0,5	-	-	10,5
Тема 4. Оценка предпринимательских рисков	12	2	2	-	-	8	12	1	0,5	-	-	10,5
Тема 5. Экспертный метод анализа риска	12	2	2	-	-	8	12	1	0,5	-	-	10,5
Тема 6. Анализ риска методом имитационного моделирования Монте-Карло	12	2	2	-	-	8	12	1	1	-	-	10
Итого по смысловому модулю 2	48	8	8	-	-	32	48	4	2,5	-	-	41,5
Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска												
Тема 7. Страхование – основной прием риск – менеджмента	12	2	2	-	-	8	11	1	0,5	-	-	9,5

Тема 8. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и риска	12	2	2	-	-	8	11	1	1	-	-	9
Тема 9. Запасы и резервы как способы снижения риска	12,85	2	2	-	-	8,85	12,55	1	1	-	-	10,55
Итого по смысловому модулю 3	36,85	6	6	-	-	24,85	34,55	3	2,5	-	-	29,05
Всего часов	106,85	18	16	-	-	72,85	104,55	8	6	-	-	90,55
Катт	0,9	-	-	-	0,9	-	1,2	-	-	-	1,2	-
СРэк	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ИК	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
КЭ	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Каттэк	0,25	-	-	-	0,25	-	0,25	-	-	-	0,25	-
Контроль	-	-	-	-	-	-	2	-	-	-	2	-
Всего часов	108	18	16	-	1,15	72,85	108	8	6	-	3,45	90,55

Примечания: Лек – лекции, Лаб – лабораторные занятия, Пр – практические занятия, ИК – индивидуальные консультации, Катт – контактная работа на аттестацию в период теоретического обучения, в период прохождения практик, СР – самостоятельная работа, КЭ – консультации экзаменационные, Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационной сессии и итоговой аттестации

7. ТЕМЫ СЕМИНАРСКИХ И ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков			
1	Тема 1. Сущность, содержание и виды риска	1	0,5
2	Тема 2. Риск в инвестировании капитала	1	0,5
Смысловой модуль 2. Моделирование и оценка финансовых рисков			
3	Тема 3. Финансовое прогнозирование на основе линейных регрессионных моделей	2	0,5
4	Тема 4. Оценка предпринимательских рисков	2	0,5
5	Тема 5. Экспертный метод анализа риска	2	0,5
6	Тема 6. Анализ риска методом имитационного моделирования Монте-Карло	2	1
Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска			
7	Тема 7. Страхование – основной прием риск – менеджмента	2	0,5
8	Тема 8. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и риска	2	1
9	Тема 9. Запасы и резервы как способы снижения риска	2	1
	ВСЕГО	**16**	**6**

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ – не предусмотрены

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1	*2*	*3*	*4*
		-	-

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков			
1	Тема 1. Сущность, содержание и виды риска	8	10
2	Тема 2. Риск в инвестировании капитала	8	10
Смысловой модуль 2. Моделирование и оценка финансовых рисков			
3	Тема 3. Финансовое прогнозирование на основе линейных регрессионных моделей	8	10,5
4	Тема 4. Оценка предпринимательских рисков	8	10,5
5	Тема 5. Экспертный метод анализа риска	8	10,5
6	Тема 6. Анализ риска методом имитационного моделирования Монте-Карло	8	10
Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска			
7	Тема 7. Страхование – основной прием риск – менеджмента	8	9,5
8	Тема 8. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и риска	8	9
9	Тема 9. Запасы и резервы как способы снижения риска	8,85	10,55
	ВСЕГО	**72,85**	**90,55**

10. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ДЛЯ ЛИЦ С ОГРАНИЧЕННЫМИ ВОЗМОЖНОСТЯМИ ЗДОРОВЬЯ И ИНВАЛИДОВ

В ходе реализации учебной дисциплины используются следующие дополнительные методы обучения, текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся в зависимости от их индивидуальных особенностей:

1) для слепых и слабовидящих:

- лекции оформляются в виде электронного документа;
- письменные задания оформляются увеличенным шрифтом или заменяются устным ответом;

2) для глухих и слабослышащих:

- лекции оформляются в виде электронного документа;
- письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
- экзамен проводится в письменной форме на компьютере; возможно проведение в форме тестирования с использованием дистанционной системы Moodle;

3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- лекции оформляются в виде электронного документа;
- письменные задания заменяются устным ответом;
- экзамен проводится в устной форме.

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения промежуточной аттестации для обучающихся устанавливается с учётом их индивидуальных психофизических особенностей. Промежуточная аттестация может проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Эти средства могут быть предоставлены университетом, или могут использоваться собственные технические средства.

Проведение процедуры оценивания результатов обучения допускается с использованием дистанционных образовательных технологий.

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в сети Интернет для каждого обучающегося в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

1) для слепых и слабовидящих:

- в печатной форме увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа.

2) для глухих и слабослышащих:
- в печатной форме;
- в форме электронного документа.

3) для обучающихся с нарушениями опорно-двигательного аппарата:
- в печатной форме;
- в форме электронного документа.

11. ИНДИВИДУАЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ

Вопросы для текущего модульного контроля (ТМК)

Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков

1. Сущность, содержание и виды риска;
2. Предприятие, как атрибут рыночной экономики, его сущность и виды рисков;
3. Предприятие и его сущностная характеристика функционирования предприятий в условиях неопределенности;
4. Неопределенность и ее виды;
5. Особенности управления предприятием в условиях неопределенности.
6. Риск в инвестировании капитала;
7. Общие проблемы, главные цели менеджмента и риск;
8. Объективные и субъективные причины возникновения предпринимательского риска;
9. Определение понятия "риска";
10. Основные моменты характеризуя рисковую ситуацию;
11. Виды убытков сопровождающие предпринимательскую деятельность, их количественное определение;
12. Качественное и количественное определение экономического риска;
13. Теории предпринимательского риска;
14. Факторы, влияющие на уровень предпринимательский риск;
15. Классификация предпринимательских рисков по различным признакам;
16. Социально-политические и административно-законодательные риски;
17. Отраслевой риск.

Смысловой модуль 2. Виды финансовых рисков, моделирование и оценка финансовых рисков

1. Способы оценки степени риска;
2. Общие подходы к количественной оценки риска в спектре экономических проблем;
3. Определение уровня риска в абсолютном и относительном выражении;
4. Зоны риска и уровне вероятностей, которые характеризуют;
5. Кривая распределения вероятностей случайных убытков и причины их построения;
6. Методы измерения уровня риска;
7. Статистический метод и метод экспертных оценок;
8. Другие методы измерения риска;
9. Оценка предпринимательских рисков;
10. Существенно содержательная характеристика производственных рисков, их классификация и влияние на деятельность предприятия;
11. Чисто производственные риски;
12. Снабженческие риски, их сущность, прогнозирования и возможные меры их предотвращения;
13. Технические риски (риски НИОКР), источники их возникновения и возможные способы снижения их уровня;
14. Транспортные риски, их сущность и классификация;
15. Убыточные (маркетинговые) риски, их сущность прогнозирования их возникновения и возможные меры предотвращения;
16. Система управления риском;

17. Основные направления поведения субъектов предпринимательства в отношении риска;
18. Во избежание появления возможных рисков и принятия риска на себя;
19. Самострахование, распределение и объединение рисков;
20. Диверсификация как метод снижения риска, ее сущность и виды;
21. Передача (трансферт) риска, ее сущность и виды;
22. Страхование предпринимательских рисков, его сущность, виды и методы;
23. Пути снижения внутренних рисков;
24. Анализ риска;
25. Характеристика финансовых рисков, их сущность и классификация;
26. Риски недофинансирования и их предотвращение;
27. Риски увеличения рыночных цен на ресурсы и превышение планируемого сметы расходов;
28. Кредитные риски;
29. Валютные риски;
30. Инвестиционные риски, их сущность и организация качественного и количественного анализа инвестиционных проектов;
31. Риски от операций с ценными бумагами;
32. Сущность модели оценки капиталовложений при наличии фактора неопределенности.

Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска

1. Страхование – основной прием риск – менеджмента;
2. Сущность и содержание риск-менеджмента;
3. Стратегия, тактика и функции;
4. Организация и способы (правила) риск-менеджмента;
5. Страхование - основной способ риск-менеджмента;
6. Системы страховой ответственности и определения сумм возмещения в некоторых страховых случаях;
7. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и риска;
8. Оценка риска ликвидности инвестиций;
9. Диверсификация инвестиций и ее сущность;
10. Портфель ценных бумаг;
11. Общие положения;
12. Теория портфеля;
13. Сущность, управление портфелем ценных бумаг;
14. Система целей при формировании портфеля и риск портфеля;
15. Норма прибыли и риск ценных бумаг;
16. Коэффициент чувствительности бета - (β-коэффициент);
17. Корреляция ценных бумаг и ее применения;
18. Портфель из двух различных акций и определения его основных характеристик - норм прибыли (доходности) и риска;
19. Портфель из многих акций;
20. Упрощенная классическая модель (модель Шарпа) формирование портфеля;
21. Характеристическая линия ценной бумаги;
22. Систематический и специфический (не систематический) риск ценной бумаги и портфеля ценных бумаг;
23. Влияние риска и инфляции на норму процента доходности ценной бумаги;
24. Запасы и резервы как способы снижения риска;
25. Структура и виды запасов, резервов на непредвиденные расходы;
26. Резервирование денежных средств на покрытие случайных расходов;
27. Управление запасами с учетом риска.

12. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ ЗНАНИЙ ОБУЧАЮЩИХСЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ОБУЧАЮЩИХСЯ

Оценочные средства детализируются по видам работ в оценочных материалах по учебной дисциплине, которые утверждаются на заседании кафедры.

Система оценивания по учебной дисциплине по очной форме обучения*

Форма контроля	**Макс. количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль: - дискуссия, собеседование (темы 1,2, 11,12) - разноуровневые задачи и задания (темы 3-10) - текущий модульный контроль (тест)	 6 6 6	 60 20 20
Промежуточная аттестация	*зачёт*	*100*
Итого за семестр	*100*	

* в соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Система оценивания по учебной дисциплине на заочной форме обучения

Форма контроля	**Макс. количество баллов**	
	За одну работу	**Всего**
Текущий контроль: - тестирование - разноуровневые задачи и задания - контрольная работа	 6 6 40	 30 30 40
Промежуточная аттестация	*зачёт*	*100*
Итого за семестр	*100*	

Вопросы для подготовки к зачёту:

1. Соотношение эффективности и риска в предпринимательской деятельности.
2. Инновационная предпринимательская деятельность и риск.
3. Из истории возникновения и развития предпринимательства как рисковой формы деятельности.
4. Предпринимательский риск и собственность.
5. Эволюция отношения к феномену предпринимательского риска.
6. Развитие изучения роли предпринимательского риска в российской экономике.
7. Риски, вызванные организационной структурой производства и управления.
8. Риск, обусловленный поведением конкурентов.
9. Риск неоптимального распределения ресурсов.
10. Специальные виды потерь.
11. Возможность прогнозирования случайных видов потерь.
12. Качественная оценка уровней потерь.
13. Особенности расчетно-аналитического способа построения кривой риска.
14. Финансовая деятельность и зоны риска.
15. Рисковая функция страхования.
16. Современная портфельная теория.
17. Оценка риска инвестиционного проекта на практике.
18. Стратегия и тактика в управлении предпринимательским риском.
19. Риск-менеджмент и практика.
20. Риск-менеджмент как самостоятельная форма предпринимательской деятельности.
21. Управление банковскими рисками.
22. Сферы возникновения банковских рисков.
23. Хеджирование, как метод снижения степени финансовых рисков.
24. Валютный рынок и развития международной финансово-кредитной системы.
25. Валютный риск и развитие международных рыночных отношений.

26. Факторы, определяющие финансово-кредитный риск *страны*.
27. Риск иностранного кредитования и его отличие от риска прямых иностранных инвестиций.
28. Финансово-кредитный риск в международных отношениях.
29. Влияние предпринимательского риска на развитие научно-технического прогресса.
30. Предпринимательский риск и развитие законодательной системы.
31. Предпринимательский риск как инструмент воздействия на рыночную экономику.
32. Риски при вложении ценных бумаг.
33. Способы минимизации банковских рисков.
34. Стратегический менеджмент и управление рисками.
35. Метод экспертных оценок и метод делфи.
36. Статистический метод, Value at Risk (VaR), метод Монте-Карло.
37. История возникновения прогнозирования рисков как науки.
38. Общенаучные подходы к управлению рисками на предприятии.
39. Специальные методы в управлении рисками.
40. Риск-менеджмент на предприятии.
41. Страхование как способ минимизации риска.
42. Самострахование и внутренние резервы предприятия как способ снижения риска.
43. Методы математического моделирования рисков.
44. Оценка рисков с применением вычислительной техники.
45. Анализ рисков и максимизация прибыли предприятия.
46. 45.Риск-менеджмент необходимость при ведении хозяйственной деятельности.
47. Риск как обязательный элемент экономической деятельность.
48. Риски связанные с использованием венчурного капитала.
49. Построение дерева решений для принятия решений в рисковых ситуациях.
50. Методы прогнозирования при оптимизации внутренних запасов.
51. Суть модели М. Миллера и Д. Орра при управлении рисками.
52. Актуальность страхования при управлении рисками.
53. Венчурный капитал или рисковые инвестиции.
54. Степень риска при венчурном капитале.
55. Предпринимательский риск как инструмент воздействия на рыночную экономику.
56. Графические методы определения риска.
57. Метод наименьших квадратов как один из точных в прогнозировании рисков.
58. Теория игр и случайные величины при прогнозировании риска.
59. Компьютерное моделирование риска.
60. Методы оценки и минимизации предпринимательских рисков.
61. Графические методы принятия решений в рисковых ситуациях.
62. Внутренние и внешние риски предприятия как неотъемлемая составляющая ведения предпринимательства.

13. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу									**Максимальная сумма баллов**
Смысловой модуль 1		Смысловой модуль 2				Смысловой модуль 3			
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	Т7	Т8	Т9	
10	10	10	10	10	10	10	10	20	100

Примечание. Т1, Т2, ... Т9 – номера тем соответствующих смысловых модулей

Соответствие государственной шкалы оценивания академической успеваемости и шкалы

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	По государственной шкале	Определение
90-100	«Отлично» (5)	отличное выполнение с незначительным количеством неточностей
80-89	«Хорошо» (4)	в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 10%)
75-79		в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 15%)
70-74	«Удовлетворительно» (3)	неплохо, но со значительным количеством недостатков
60-69		выполнение удовлетворяет минимальные критерии
35-59	«Неудовлетворительно» (2)	с возможностью повторной аттестации
0-34		с обязательным повторным изучением дисциплины (выставляется комиссией)

14. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА\

Основная литература:

1. Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. — 6-е изд. — Москва : Дашков и К, 2023. — 418 c. — ISBN 978-5-394-05185-2. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/144056.html

2. Балдин, К. В. Управление рисками : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2023. — 511 c. — ISBN 5-238-00861-9. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/142671.html

3. Логанина, В. И. Управление рисками в системе менеджмента качества : учебное пособие по направлению подготовки 27.03.02 «Управление качеством» / В. И. Логанина, Т. В. Учаева. — Пенза : Пензенский государственный университет архитектуры и строительства, ЭБС АСВ, 2021. — 128 c. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/138671.html

Дополнительная литература:

1. Бурда, А. Г. Основы финансовых вычислений : учебное пособие для обучающихся по направлению подготовки бакалавриата «Экономика» / А. Г. Бурда. — Краснодар, Саратов : Южный институт менеджмента, Ай Пи Эр Медиа, 2018. — 104 c. — ISBN 978-5-93926-318-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/78039.html

2. Чикина, Е. Д. Финансовые вычисления в экономике : учебное пособие / Е. Д. Чикина. — Белгород : Белгородский государственный технологический университет им. В.Г. Шухова, ЭБС АСВ, 2017. — 193 c. — ISBN 2227-8397. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/80478.html

3. Учебно-методическое пособие по дисциплине Основы финансовых вычислений / составители Ю. В. Устинова. — Москва : Московский технический университет связи и информатики, 2016. — 40 c. — ISBN 2227-8397. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/61519.html

4. Токтошов, Г. Ы. Финансовая математика : учебное пособие / Г. Ы. Токтошов. — Новосибирск : Сибирский государственный университет телекоммуникаций и информатики, 2019. — 131 c. —

ISBN 2227-8397. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/90603.html
5. Лай, Чжун Элементарный курс теории вероятностей. Стохастические процессы и финансовая математика / Кай Чжун Лай, АитСахлиа Фарид ; перевод М. Б. Лагутин. — 3-е изд. — Москва : Лаборатория знаний, 2017. — 456 с. — ISBN 978-5-00101-524-6. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/89018.html
6. Ю-Дау, Люу Методы и алгоритмы финансовой математики / Люу Ю-Дау ; под редакцией Е. В. Чепурина ; перевод С. В. Жуленев. — 3-е изд. — Москва : Лаборатория знаний, 2017. — 752 с. — ISBN 978-5-00101-519-2. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/89017.html
7. Экономика биржевой торговли [Электронный ресурс]: учеб. пособие / И. В. Ковалева, Е. С. Кравченко; М-во образования и науки ДНР, Гос. орг. высш. проф. образования "Донец. нац. ун-т экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского", Каф. экономики предприятия. — Донецк: ДонНУЭТ, 2016. — Локал. компьютер. сеть НБ ДонНУЭТ.

Учебно-методические издания:

1. Моделирование и управление рисками экономической деятельности. Дистанционный курс в системе Moodle. [Электронный ресурс] / Режим доступа: http://distant.donnuet.ru/

15. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Unilib UC : автоматизир. библ. информ. система : версия 2.110 // Научная библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – Донецк, 2003– . – Режим доступа : для зарегистирир. пользователей в локальной сети НБ ДОННУЭТ. – Текст : электронный.
2. Электронный каталог Научной библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – Донецк : НБ ДОННУЭТ, 1999– . – URL: http://catalog.donnuet.ru. – Текст : электронный.
3. Информио : электрон. справочник / ООО «РИНФИЦ». – Москва : Издат. дом «Информио», [2018?–]. – URL: https://www.informio.ru/. – Текст : электронный.
4. IPRsmart : весь контент ЭБС IPR BOOKS : цифровой образоват. ресурс / ООО «Ай Пи Эр Медиа». – [Саратов : Ай Пи Эр Медиа, 2022]. – URL:http://www.iprbookshop.ru. – Режим доступа : для авторизир. пользователей. – Текст. Аудио. Изображения : электронные.
5. Лань : электронно.-библ. система. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2021. –URL: https://e.lanbook.com/. – Режим доступа : для авторизир. пользователей. – Текст : электронный.
6. СЭБ : Консорциум сетевых электрон. б-к / Электрон.-библ. система «Лань» при поддержке Агенства стратег. инициатив. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2021. – URL: https://e.lanbook.com/. – Режим доступа : для пользователей организаций-участников, подписчиков ЭБС «Лань». – Текст : электронный.
7. Русская история : электрон. версия журнала / Мультимедийный молодежный портал «Русская история». – Москва, 2008– . – URL: http://rus-ist.ru. – Режим доступа: для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.
8. Научно-информационный библиотечный центр имени академика Л. И. Абалкина : электронная библиотека / Рос. экон. ун-т им. акад. Г.В. Плеханова. – Москва : KnowledgeTree Inc., 2008– . – URL: http://liber.rea.ru/login.php. – Режим доступа : для авторизир. пользователей. – Текст : электронный.
9. book on lime : электрон. библ. система : дистанц. образование / Изд-во КДУ МГУ им. М.В. Ломоносова. – Москва : КДУ, cop. 2017. – URL: https://bookonlime.ru. – Текст. Изображение. Устная речь : электронный.
10. Polpred : электрон. библ. система : деловые статьи и интернет-сервисы / ООО «Полпред Справочники». – Москва : Полпред Справочники, cop. 1997–2022. – URL: https://polpred.com. – Текст : электронный.
11. CYBERLENINKA : науч. электрон. б-ка «КиберЛенинка» / [Е. Кисляк, Д. Семячкин, М.

Сергеев ; ООО «Итеос»]. – Москва : КиберЛенинка, 2012– . – URL: http://cyberleninka.ru. – Текст : электронный.

12. Научная электронная библиотека elibrary.RU : информ.-аналит. портал / ООО Научная электронная библиотека. – Москва : ООО Науч. электрон. б-ка, 2000–2022. – URL: https://elibrary.ru. – Режим доступа : для зарегистрир. пользователей. – Текст : электронный.

13. Национальная электронная библиотека : НЭБ : федер. гос. информ. система / М-во культуры Рос. Федерации [и др.]. – Москва : Рос. гос. б-ка : ООО ЭЛАР, [2008–]. – URL: https://rusneb.ru/. – Текст. Изображение : электронный.

14. Электронный каталог Научной библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского [Электронный ресурс] / НБ ДонНУЭТ. – Электрон. дан. – [Донецк, 1999-]. – Режим доступа: http://catalog.donnuet.education – Загл. с экрана.

15. Система дистанционного обучения Донецкого национального университета экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского [Электронный ресурс] / Режим доступа: http://distant.donnuet.ru/

16. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Минимально необходимый для реализации ОПОП ВО специалитета перечень материально-технического обеспечения включает аудиторный фонд в соответствии с утвержденным расписанием с использованием мультимедийного демонстрационного комплекса кафедры финансов (проектор, ноутбук).

17. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Фамилия, имя, отчества	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства; на условиях договора гражданско-правового характера (далее – договор ГПХ)	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специальности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании
Малецкий Антон Викторович	По основному месту работы	Должность – доцент, кандидат экономических наук, ученое звание доцент	Высшее, менеджмент организаций, магистр, диплом кандидата экономических наук ДК № 019737	1. Удостоверение о повышении квалификации №110400009602 от 28.02.2022г., «Информационные технологии в образовании», 72 часа, Филиал Ухтинского государственного технического университета, г. Усинск 2. Удостоверение о повышении квалификации №612400026672, 21.09.2022г., «Актуальные вопросы преподавания в образовательных учреждениях высшего образования: нормативно-правовое, психолого-педатогическое и методическое сопровождение» 24 часа, ФГБОУ ВО "Донской государственный технический университет", Ростов-на-Дону. 3.Удостоверение о повышении квалификации №QB 0522107033 от 28.11.2022г., «Разработка и внедрение дистанционных курсов на базе дистанционного обучения Moodle», 76 часа, ГО ВПО "ДонНУЭТ" ЦДПО, Донецк 4. Удостоверение о повышении квалификации №612400030707 от 19.05.2023г., «Организационно-методические аспекты разработки и реализации программ высшего образования по направлениям подготовки Экономика и управление», 36 часов, ФГБОУ ВО "Донской государственный технический университет", Ростов-на-Дону.

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ
УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.ДВ.03.01 «МОДЕЛИРОВАНИЕ И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ»

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность

Трудоемкость учебной дисциплины: 3 з.е.

Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине:

знать: сущность и теоретические основы организации финансового менеджмента, методический инструментарий управления финансами предприятий, методики определения стоимости капитала, оптимизации его структуры, содержание финансовых планов и методы планирования; методики анализа финансовых отчетов предприятия, направления антикризисного финансового управления предприятием;

уметь: применять на практике навыки по использованию современных методов системного научного анализа, разрабатывать финансовую политику и стратегии развития организаций, проводить эффективную политику управления движением денежных потоков, формированием и использованием финансовых ресурсов, самостоятельно принимать решения по их оптимизации;

владеть: приемами управления денежными потоками предприятия, системным подходом к управлению прибылью, активами, инвестициями, капиталом, оценивать финансовое состояние и финансовые риски, использовать инструменты антикризисного управления предприятием.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
ПК-1 Способен осуществлять эксплуатацию интегрированной системы управления рисками.	ИД-1$_{ПК-1}$ Анализирует функционирование системы управления рисками ИД-2$_{ПК-1}$ Осуществляет выработку рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками

Наименование смысловых модулей и тем учебной дисциплины:

Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков. Тема 1. Сущность, содержание и виды риска. Тема 2. Риск в инвестировании капитала.

Смысловой модуль 2. Моделирование и оценка финансовых рисков. Тема 3. Финансовое прогнозирование на основе линейных регрессионных моделей. Тема 4. Оценка предпринимательских рисков. Тема 5. Экспертный метод анализа риска. Тема 6. Анализ риска методом имитационного моделирования Монте-Карло.

Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска. Тема 7. Страхование основной прием риск – менеджмента. Тема 8. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и рис Тема 9. Запасы и резервы как способы снижения риска

Форма промежуточной аттестации: зачёт

Разработчик:
Малецкий А.В., кандидат экономических наук, доцент

(подпись)

Заведующий кафедрой финансов и экономической безопасности
Омельянович Л.А., доктор экономических наук, профессор

(подпись)