Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 09.11.2026 20:14:45
Уникальный программный ключ:
b066544bae1e449cd8bfce392f7224a676a271b2

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)
« 26 » февраля 2025 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.12 УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

(шифр, название учебной дисциплины в соответствии с учебным планом)

Укрупненная группа Специальности 38.05.01
(код, наименование)

Программа высшего образования – программа специалитета

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность
(код, наименование)

Специализация -Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
(наименование)

Институт Институт учёта и финансов

Форма обучения, курс:
очная форма обучения, 4 курс
очно-заочная форма обучения, 5 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Донецк
2025

Рабочая программа учебной дисциплины «Управление рисками» для обучающихся по Специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, Специализации: -Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности, разработанная в соответствии с учебным планом, утвержденным Ученым советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»:
- в 2025 г. - для очной формы обучения;
- в 2025 г. - для заочной формы обучения.

Разработчик: Верич Юлия Леонидовна, доцент кафедры финансов и экономической безопасности, кандидат экономических наук, доцент

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры финансов и экономической безопасности
Протокол от « » февраля 2025 года №
Зав. кафедрой финансов и экономической безопасности

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

СОГЛАСОВАНО:
Директор института Институт учёта и финансов

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

« » февраля 2025 года

ОДОБРЕНО
Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»
Протокол от « 26 » февраля 2025 года № 7
Председатель_____ Л. В. Крылова
(подпись) (инициалы, фамилия)

© Верич Ю.Л., 2025 год
© Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2025 год

1. ОПИСАНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

<table>
<tr><td rowspan="2">Наименование показателя</td><td rowspan="2">Наименование укрупненной группы направлений подготовки, направление подготовки, профиль, 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 rowspan="2">Количество зачетных единиц – 4</td><td>Укрупненная группа Специальности 38.05.01</td><td colspan="2" rowspan="2">Часть, формируемая участниками образовательных отношений</td></tr>
<tr><td>Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность</td></tr>
<tr><td>Модулей – 1</td><td rowspan="4">Специализация:
-Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности</td><td colspan="2">Год подготовки</td></tr>
<tr><td>Смысловых модулей – 2</td><td>4-й</td><td>5-й</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Общее количество часов – 144</td><td colspan="2">Семестр</td></tr>
<tr><td>8-й</td><td>зимняя сессия</td></tr>
<tr><td rowspan="15">Количество часов в неделю для очной формы обучения:
аудиторных – 2,8;
самостоятельной работы обучающегося – 3,6</td><td rowspan="15">Программа высшего образования – программа специалитета</td><td colspan="2">Лекции</td></tr>
<tr><td>32 часов</td><td>8 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Практические, семинарские занятия</td></tr>
<tr><td>16 часов</td><td>8 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Лабораторные занятия</td></tr>
<tr><td>-</td><td>-</td></tr>
<tr><td colspan="2">Самостоятельная работа</td></tr>
<tr><td>62 часов</td><td>113,4 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Индивидуальные задания:</td></tr>
<tr><td>2 ТМК</td><td>курсовая работа</td></tr>
<tr><td colspan="2">Форма промежуточной аттестации:</td></tr>
<tr><td>Экзамен</td><td>Экзамен</td></tr>
</table>

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:
для очной формы обучения –48/ 62
для заочной формы обучения – 16/113,4

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель учебной дисциплины: сформировать у обучающихся теоретические знания и практические навыки по анализу и управлению рисками организаций.
Задачи учебной дисциплины: изучить основные понятия, свойства и классификацию рисков; ознакомиться с методами качественного и количественного анализа рисков; рассмотреть составляющие и принципы построения системы управления рисками; изучить стратегии и инструменты реагирования на риски

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО

Учебная дисциплина Б1.В.12 «Управление рисками» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений ООП ВО. Изучается в 7 семестре, вид контроля – экзамен.

Для изучения курса «Управление рисками» требуются знания и навыки по следующим дисциплинам: «Финансы предприятий», «Математический анализ», «Теория вероятностей и математическая статистика», «Статистика», «Основы экономической безопасности», «Менеджмент», «Социология», «Экономика организации (предприятия)», «Инвестиции».

Требования к «входным» знаниям, умениям и готовностям обучающегося, необходимые при освоении данной дисциплины и приобретенным в результате освоения предшествующих дисциплин – удовлетворительное усвоение программ по указанным выше дисциплинам.

Теоретические дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: Финансовая безопасность, Моделирование и управление рисками экономической деятельности, Корпоративные финансовые риски, Практика по профилю профессиональной деятельности.

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-2 Способен консультировать по вопросам управления рисками в организации	ИД-1ПК-2 Информирует и консультирует заинтересованные стороны по вопросам управления рисками
	ИД-2ПК-2 Представляет позиции организации в сфере управления рисками

В результате изучения учебной дисциплины обучающийся должен:

знать: этапы развития теории риска; свойства риска; сущность, содержание и классификацию рисков; место качественного и количественного анализа в системе управления риском; классификацию методов анализа рисков; составляющие системы управления рисками; суть стратегий реагирования на риски; инструменты реагирования на риски;

уметь: анализировать во взаимосвязи финансово-экономические явления и процессы, характеризующие внутреннюю и внешнюю среду и делать обоснованные выводы; рассчитывать и интерпретировать результаты расчетов статистических характеристик; использовать современное программное обеспечение для разработки и реализации управленческих решений, а также оценки их эффективности; использовать современные методы организации эффективного риск-менеджмента; проводить анализ чувствительности; оценивать степень воздействия операционного и финансового рычагов; оценивать запас финансовой прочности.

владеть: навыками математико-статистического анализа рисков, анализа чувствительности, расчета ожидаемой и требуемой доходности.

5. ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

Смысловой модуль 1. Сущность и основные теоретические подходы к теории рисков
Тема 1. Понятие о риске и неопределенности
Тема 2. Информационное обеспечение управления рисками
Тема 3. Типология решений и критерии выбора в рисковых ситуациях
Тема 4. Риск и доходность
Смысловой модуль 2. Система управления рисками
Тема 5. Система управления рисками предприятия
Тема 6. Идентификация и качественная оценка рисков
Тема 7. Количественная оценка рисков
Тема 8. Методы реагирования на риски
Тема 9. Мониторинг и контроль рисков

6. СТРУКТУРА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Название 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]	СР[5]		л	п	лаб	инд	СР
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Модуль 1. Управление рисками												
Смысловой модуль 1. Сущность и основные теоретические подходы к теории рисков												
Тема 1. Понятие о риске и неопределенности	12	4	1	-	-	7	13	1		-	-	12
Тема 2. Информационное обеспечение управления рисками	11	4	1	-	-	6	13	1		-	-	12
Тема 3. Типология решений и критерии выбора в рисковых ситуациях	11,0	2	2	-	-	7,0	15	1	2	-	-	12
Тема 4. Риск и доходность	11	2	2	-	-	7	14		1	-	-	13
Итого по смысловому модулю 1	***45,0***	***12***	***6***	-	-	***27,0***	***55***	***3***	***3***	-	-	***49***
Смысловой модуль 2. Система управления рисками												
Тема 5. Система управления рисками предприятия	13	4	2	-	-	7	14	1		-	-	13
Тема 6. Идентификация и качественная оценка рисков	13	4	2	-	-	7	16	1	2	-	-	13

Тема 7. Количественная оценка рисков	13	4	2	-	-	7	16,4	1	2	-	-	13,4
Тема 8. Методы реагирования на риски	13	4	2	-	-	7	15,0	1	1	-	-	13,0
Тема 9. Мониторинг и контроль рисков	13	4	2	-	-	7	13	1		-	-	12
Итого по смысловому модулю 2	***65***	***20***	***10***	**-**	**-**	***35***	***74,4***	***5***	***5***	**-**	**-**	***64,4***
Всего по смысловым модулям	**116,0**	**32**	**16**	**-**	**-**	**62,0**	**129,4**	**8**	**8**	**-**	**-**	**113,4**
ИК	*1*	-	-	-	*1*	-	*1*	-	-	-	1	-
Катт	*3,6*	-	-	-	*3,6*	-		-	3,2-	-	*3,2*	-
Срэк		-	-	-	-		-	-	-	-	-	-
КЭ	*2,0*	-	-	-	*2,0*	-	*2*	-	-	-	*2*	-
Каттэк	*0,4*	-	-	-	*0,4*	-	*0,4*	-	-	-	*0,4*	-
Контроль	*27*				*27*		*8*				*8*	
Всего часов	**144**	**32**	**16**	-	**34**	**62,0**	**144**	**8**	**8**	-	***14,6***	**113,4**

Примечания: 1. л – лекции; 2. п – практические (семинарские) занятия; 3. лаб – лабораторные занятия; 4. инд – индивидуальные задания; 5. СР – самостоятельная работа.

7. ТЕМЫ СЕМИНАРСКИХ И ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

номер п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1.	Понятие о риске и неопределенности	1	
2.	Информационное обеспечение управления рисками	1	
3.	Типология решений и критерии выбора в рисковых ситуациях	2	2
4.	Риск и доходность	2	1
5.	Система управления рисками предприятия	2	
6.	Идентификация и качественная оценка рисков	2	2
7.	Количественная оценка рисков	2	2
8.	Методы реагирования на риски	2	1
9.	Мониторинг и контроль рисков	2	
Всего:		16	0

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ РАБОТ - Не предусмотрены

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

номер п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1.	Понятие о риске и неопределенности	7	12
2.	Информационное обеспечение управления рисками	6	12
3.	Типология решений и критерии выбора в рисковых ситуациях	7	12
4.	Риск и доходность	7	13

5.	Система управления рисками предприятия	7	13
6.	Идентификация и качественная оценка рисков	7	13
7.	Количественная оценка рисков	7	13,4
8.	Методы реагирования на риски	7	13
9.	Мониторинг и контроль рисков	7	12
Всего:		62	113,4

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;
- зачёт 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;
- зачёт 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. Сущность и основные теоретические подходы к теории рисков

1. Перечислите исследователей, внесших наибольший вклад в развитие теории риска.

2. Сформулируйте понятие риска, перечислите его признаки.
3. Опишите разницу между чистым и спекулятивным риском.
4. Укажите на различия между понятиями «риск» и «неопределенность».
5. Укажите на различия между понятиями «риск» и «опасность».
6. Приведите пример эндогенных и экзогенных факторов риска.
7. Дайте определение рисковой ситуации.
8. Перечислите классификационные признаки риска и виды рисков. Охарактеризуйте их.
9. Перечислите этапы управления риском.
10. Охарактеризуйте реестр рисков с точки зрения его содержания и процесса заполнения.
11. Проанализируйте роль информации в управлении риском.
12. Перечислите составляющие информационного обеспечения риск-менеджмента.
13. Опишите принцип структурирования информационных потоков о внешних воздействиях
14. Опишите различия между формализованной и неформализованной информацией.
15. Перечислите внешних и внутренних пользователей финансовой информации.
16. Перечислите и охарактеризуйте типы информации, используемой при исследовании рисков.
17. Дайте определение качества информации. Перечислите его составляющие.
18. Перечислите способы манипулирования отчетностью.
19. Опишите способы ненадлежащего признания доходов.
20. Перечислите способы манипулирования показателем прибыли.

Смысловой модуль 2. Система управления рисками

1. Опишите цели, задачи и ключевые принципы построения системы управления рисками на предприятии.
2. Раскройте содержание модели "трех линий защиты" в интегрированной системе риск-менеджмента (ERM).
3. Что такое "риск-аппетит" и "толерантность к риску"? Объясните их роль в формировании политики управления рисками.
4. Перечислите и охарактеризуйте основные методы идентификации рисков (мозговой штурм, метод Дельфи, SWOT-анализ, диаграмма Исикавы).
5. Что такое реестр рисков? Опишите его структуру и назначение.
6. Охарактеризуйте качественные методы оценки рисков. Приведите пример построения матрицы рисков (карты рисков).
7. Перечислите основные количественные методы оценки рисков (статистические методы, анализ чувствительности, сценарный анализ, имитационное моделирование).
8. Раскройте сущность метода Value at Risk (VaR) и его применение для оценки финансовых рисков.
9. Назовите и охарактеризуйте четыре основные стратегии реагирования на риски (уклонение, принятие, передача, снижение).
10. Определите цели и задачи мониторинга рисков. Дайте определение ключевых индикаторов риска (KRI)
11. Сравните традиционный (фрагментарный) подход к управлению рисками и интегрированный (ERM).
12. Опишите процесс создания паспорта риска: ключевые разделы и их содержание.
13. Опишите как анализ чувствительности применяется для оценки влияния отдельных факторов на результат.
14. Раскройте сущность сценарного анализа и его отличие от анализа чувствительности.
15. Какие инструменты используются для снижения (минимизации) рисков? Приведите примеры.
16. Что такое передача риска? Назовите основные инструменты передачи риска (страхование, хеджирование, аутсорсинг).
17. Объясните стратегию принятия (сохранения) риска. Когда она целесообразна? Что такое самострахование?
18. Что такое комплаенс-риск и каковы основные методы управления им?
19. Опишите роль и функции подразделения по управлению рисками (риск-менеджера) в организации.

20. Раскройте понятие "риск-культура" и ее значение для эффективности системы управления рисками.

Тематика курсовых работ

1. Комплексный анализ и классификация предпринимательских рисков на предприятии.
2. Разработка интегрированной системы управления рисками (ERM) в организации (учреждении).
3. Совершенствование процесса идентификации и оценки рисков в деятельности предприятия (организации).
4. Формирование и внедрение политики управления рисками (с определением риск-аппетита) на предприятии.
5. Интеграция системы управления рисками в процессы стратегического планирования организации.
6. Анализ и развитие риск-культуры как элемента корпоративного управления на предприятии (в организации).
7. Организация процесса мониторинга и контроля рисков на предприятии (в организации): анализ и рекомендации.
8. Формирование информационной системы управления рисками на основе ключевых индикаторов (KRI) на предприятии.
9. Применение модели «трех линий защиты» для совершенствования системы управления рисками в организации.
10. Оценка эффективности системы управления рисками на предприятии (в организации).
11. Система управления финансовыми рисками на предприятии: комплексный анализ.
12. Анализ взаимосвязи риска и доходности в финансовой деятельности предприятия.
13. Управление кредитным риском дебиторской задолженности на предприятии.
14. Управление риском ликвидности в организации (учреждении).
15. Управление валютным риском на предприятии.
16. Управление налоговыми рисками в деятельности предприятия (организации).
17. Страхование как инструмент управления финансовыми рисками в деятельности организации.
18. Система управления рисками коммерческого банка.
19. Управление кредитным риском в деятельности коммерческого банка.
20. Анализ и управление риском ликвидности в коммерческом банке.
21. Управление процентным риском в коммерческом банке.
22. Система управления операционными рисками в коммерческом банке.
23. Управление рисками в деятельности страховой компании.
24. Совершенствование системы внутреннего контроля для минимизации рисков в финансовом учреждении.
25. Совершенствование системы внутреннего финансового контроля для минимизации рисков на предприятии.
26. Управление операционными рисками на предприятии: идентификация, оценка и методы снижения.
27. Анализ и управление кадровыми рисками в системе экономической безопасности организации (учреждения).
28. Управление комплаенс-рисками в деятельности организации.
29. Анализ и управление репутационными рисками организации (учреждения) в современных условиях.
30. Управление рисками в цепях поставок на предприятии.
31. Анализ и управление технологическими рисками производственного предприятия.
32. Управление проектными рисками инвестиционного проекта предприятия (организации).
33. Применение качественных методов для анализа рисков организации.
34. Применение количественных методов для оценки рисков предприятия.
35. Разработка антикризисного плана управления рисками для организации (учреждения).
36. Риск-менеджмент в системе обеспечения экономической безопасности предприятия (организации).
37. Анализ и управление рисками в деятельности бюджетного учреждения.
38. Управление рисками при реализации государственных программ и национальных проектов.
39. Анализ и управление рисками в сфере государственных (муниципальных) закупок.

40. Анализ и управление бюджетными рисками на республиканском (муниципальном) уровне.
41. Управление рисками в системе государственного финансового контроля.
42. Управление рисками при предоставлении государственных (муниципальных) услуг.
43. Разработка и внедрение системы внутреннего финансового контроля и аудита в бюджетном учреждении.
44. Управление рисками в процессе цифровой трансформации организации.
45. Анализ влияния когнитивных искажений на процесс принятия решений в системе управления рисками организации.

12. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ 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:		
- коллоквиум (темы № 1-9)	1	9
- тесты (темы № 1-9)	1	9
- практические задания (темы № 4, 6, 7, 8)	3	12
- контрольная работа (ТМК 1) (тема № 4)	5	5
- контрольная работа (ТМК 2) (тема № 9)	5	5
Промежуточная аттестация	экзамен	60
Итого за семестр	*100*	

* в соответствии с утвержденными оценочными материалами по учебной дисциплине

Вопросы для подготовки к экзамену:

1. Основные понятия риска и неопределенности. Различие между чистым и спекулятивным риском.
2. Источники риска и классификация последствий: прямой и косвенный ущерб.
3. Субъекты и объекты риска. Роли субъекта риска и субъекта потерь.
4. Модель и компоненты риска организации.
5. Различие между допустимым, критическим и катастрофическим риском. Системные и несистемные риски.
6. Классификация и характеристики операционных и финансовых рисков.
7. Принципы и стандарты управления рисками.
8. Организация процесса управления рисками и его инфраструктуры.
9. Система информационного обеспечения управления рисками: типы данных, технологии обработки, модель DIKW.
10. Качество информации и требования к ней в системе управления рисками.
11. Роль обмена информацией в управлении рисками. Взаимодействие между заинтересованными сторонами.
12. Определение контекста управления рисками: область применения, среда и критерии.
13. Риск-культура организации и её влияние на эффективность управления рисками.
14. Понятие вероятности и методы ее определения.
15. Случайные величины и их распределения. Дискретные и непрерывные случайные величины.
16. Математические характеристики риска: математическое ожидание, стандартное отклонение.
17. Правило трех сигм и его применение в оценке рисков.
18. Оценка Value at Risk (VaR) для управления финансовыми рисками.
19. Определение требуемой доходности и модель CAPM.
20. Расчет и интерпретация β-коэффициента как меры систематического риска.
21. Оценка ожидаемой доходности и волатильности инвестиционного портфеля.
22. α-коэффициент и его значение.
23. Стресс-тестирование как метод оценки рисков.

24. Процесс принятия рискового решения.
25. Модели принятия решений: сравнение рациональной и интуитивной моделей.
26. Роль и влияние личности на процесс принятия решений.
27. Мотивационные искажения в принятии решений.
28. Влияние когнитивных искажений на процесс принятия решений.
29. Оценка толерантности к риску и применение теории полезности.
30. Использование кривой безразличия для анализа предпочтений лица, принимающего решения.
31. Основные элементы и функции системы управления рисками.
32. Традиционные и современные подходы к управлению рисками.
33. Интегрированное управление рисками (ERM).
34. Модель трех линий защиты.
35. Подверженность риску: методы оценки и анализа.
36. Комплексная система управления рисками предприятий.
37. Автоматизация управления рисками.
38. Стоимость управления рисками.
39. Бенчмаркинг практик управления рисками.
40. Обязанности и ответственность владельца риска.
41. Определение и значение риск-аппетита в контексте управления рисками.
42. Создание и применение политики управления рисками.
43. Ведение и использование реестра рисков.
44. План управления риском: структура и этапы разработки.
45. Методы и инструменты идентификации рисков.
46. Создание и использование паспорта риска.
47. Разработка профиля риска и его компоненты.
48. Диаграмма Ишикавы в анализе рисков.
49. Инструменты качественного анализа рисков.
50. Инструменты количественного анализа рисков.
51. Различие и применение качественного и количественного анализов рисков.
52. Анализ чувствительности.
53. Моделирование Монте-Карло.
54. Матрица рисков: построение и применение.
55. Сравнительная оценка риска.
56. Процессы мониторинга и пересмотра рисков.
57. Понимание и применение стратегии избегания риска.
58. Методы локализации и минимизации рисков.
59. Стратегии реагирования на риск.
60. Механизмы передачи риска третьим лицам.
61. Использование диверсификации для управления рисками.
62. Роль страхования в управлении рисками.
63. Лимитирование риска: методы и применение
64. Резервирование как инструмент управления риском
65. Методы управления рыночным риском
66. Определение эффективного и оптимального портфеля
67. Механизм хеджирования рисков и его инструменты
68. Валютный риск: типы и методы управления
69. Защитные оговорки в управлении валютным риском
70. Стратегия принятия риска.
71. Инструменты управления кредитным риском.
72. Кредитные лимиты.
73. Кредитно-дефолтные свопы (CDS).
74. Прогнозирование вероятности дефолта.
75. Кредитный рейтинг и его значение.
76. Планы восстановления деятельности.
77. Антикризисное управление.
78. Управление инцидентами.
79. Контрольные процедуры управления рисками.
80. Агрегация рисков и оценка совокупного риска организации.

13. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу									Максимальная сумма баллов		
Смысловой модуль № 1				Смысловой модуль № 2					Текущий контроль	Экзамен	Все виды учебной деятельности
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	Т7	Т8	Т9	40	60	100
2	2	2	10	2	5	5	5	7			

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

Соответствие государственной шкалы оценивания академической успеваемости и шкалы ECTS

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	По государственной шкале	Определение
90-100	«Отлично» (5)	отлично – отличное выполнение с незначительным количеством неточностей
75-89	«Хорошо» (4)	хорошо – в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 10 %)
60-74	«Удовлетворительно» (3)	удовлетворительно – выполнение удовлетворяет минимальные критерии
0-59	«Неудовлетворительно» (2)	неудовлетворительно

14. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Омельянович Л.А. Управление рисками : учебное пособие по дисциплине «Управление рисками» для обуч. специальности 38.05.01 Экономическая безопасность очной и заочной формы обучения / Л.А. Омельянович, Ю.Л. Верич. – Донецк: ФГБОУ ДонНУЭТ, 2024. – 151 с.

Дополнительная:

1. Новиков, А. И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах : учебное пособие / А. И. Новиков, Т. И. Солодкая. — 2-е изд. — Москва : Дашков и К, 2019. — 285 c. — ISBN 978-5-394-03251-6. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: http://www.iprbookshop.ru/85178.html
2. Омельянович Л.А. Корпоративные финансовые риски : Учебное пособие по дисциплине для обуч. направления подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, магистерская программа Финансы и кредит / Л.А. Омельянович, Ю. Л. Верич; ГОВПО Донец. нац. ун-т. экономики и торговли им. М. Туган-Барановского, финансов. - Донецк: ГОВПО ДонНУЭТ, 2019. - 136 с. Текст : электронный // НАУЧНАЯ БИБЛИОТЕКА ГО ВПО "Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского" : [сайт]. — URL: http://library.donnuet.education/

15. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Автоматизированная библиотечная информационная система Unilib UC : версия 2.110 // Научная библиотека Донецкого национального университета экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского. – [Донецк, 2021–]. – 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. Автоматизированная интегрированная библиотечная система (АИБС) «МегаПро». – Москва : ООО «Дата Экспресс», 2024– . – Текст : электронный.
4. IPR SMART : весь контент ЭБС Ipr books : цифровой образовательный ресурс / ООО «Ай Пи Эр Медиа». – Саратов : Ай Пи Эр Медиа, 2007 –. – URL:http://www.iprbookshop.ru. – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст. Аудио. Изображения : электронные.
5. Лань : электронная-библиотечная система. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2024. – URL:https://e.lanbook.com/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
6. СЭБ : Консорциум сетевых электронных бибилиотек / Электронная-библиотечная система «Лань» при поддержке Агентства стратегических инициатив. – Санкт-Петербург : Лань, cop. 2011–2024. – URL:https://seb.e.lanbook.com/ – Режим доступа : для пользователей организаций – участников, подписчиков ЭБС «Лань». – Текст : электронный.
7. Polpred : электронная библиотечная система : деловые статьи и интернет-сервисы / ООО «Полпред Справочники». – Москва : Полпред Справочники, cop. 1997–2024. – URL:https://polpred.com. – Текст : электронный.
8. Book on lime : дистанционное образование : электронная библиотечная система / издательство КДУ МГУ им. М.В. Ломоносова. – Москва : КДУ, cop. 2017 –. – URL:https://bookonlime.ru. – Текст . Изображение. Устная речь : электронные.
9. Информио : электронный справочник / ООО «РИНФИЦ». – Москва : Издательский дом «Информио», 2009 –. – URL: https://www.informio.ru. – Текст : электронный.
10. Университетская библиотека онлайн : электронная библиотечная система. – ООО «Директ-Медиа», 2006–. – URL:https://biblioclub.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
11. Научно-информационный библиотечный центр имени академика Л.И. Абалкина / Российский экономический унтиниверситет имени В.Г. Плеханова. – Москва : KnowledgeTree Inc., 2008– . – URL:http://liber.rea.ru/login.php. – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
12. Библиотечно-информационный комплекс / Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации. – Москва : Финансовый университет, 2019– . – URL:http://library.fa.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
13. Зональная научная библиотека имени Ю.А. Жданова / Южный федеральный университет. – Ростов-на-Дону : Южный федеральный университет, 2016 – . – URL:https://library.lib.sfedu.ru/ – Режим доступа: для авторизированных пользователей. – Текст : электронный.
14. Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU: информационно- аналитический портал / ООО Научная электронная библиотека. – Москва : ООО Научная электронная библиотека, cop. 2000–2024. – URL:https://elibrary.ru. – Режим доступа: для зарегистрированных пользователей. – Текст : электронный.
15. CYBERLENINKA : Научная электронная библиотека «КиберЛенинка» / [Е. Кисляк, Д. Семячкин, М. Сергеев ; ООО «Ятеос»]. – Москва : КиберЛенинка, 2012 – . – URL:http://cyberleninka.ru. – Текст : электронный.
16. Национальная электронная библиотека : НЭБ : федеральная государственная информационная система / Министерство культуры Российской Федерации [и др.]. – Москва : Российская государственная библиотека : ООО ЭЛАР, [2008 –]. – URL:https://rusneb.ru/ – Текст. Изображение : электронные..

16. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Минимально необходимый для реализации ООП специалитета перечень материально-технического обеспечения включает аудиторный фонд учебных корпусов 4,6 в соответствии с утвержденным расписанием с использованием мультимедийного демонстрационного комплекса кафедры финансов и экономической безопасности (проектор, ноутбук)

17. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Фамилия, имя, отчество	Должность (для совместителей место основной работы, должность)	Наименование учебного заведения, которое окончил (год окончания, специальность, квалификация по диплому)	Ученая степень, шифр и наименование научной специальности, ученое звание, какой кафедрой присвоено, тема диссертации	Повышение квалификации (наименование организации, вид документа, тема, дата выдачи)
Верич Юлия Леонидовна	По основному месту работы	Должность – доцент кафедры финансов, кандидат экономических наук, ученое звание – доцент	Высшее, экономическое и социальное планирование, экономист, диплом кандидата экономических наук ДК № 035074	1. Филиал УГТУ, г. Усинск, «Информационные технологии в образовании», удостоверение о повышении квалификации, № 110400009600, 28.02.2022 г. 2. ФГБОУ ВО «Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова», г. Москва, «Работа в электронной информационно-образовательной среде», удостоверение о повышении квалификации, № 771802829939, 27.05.2022 г. 3. ФГБОУ ВО «ДГТУ», «Актуальные вопросы преподавания в образовательных учреждениях высшего образования: нормативно-правовое психолого-педагогическое и методическое сопровождение», удостоверение о повышении квалификации, 2022/0326 4. ФГБОУ ВО «Донской государственный технический университет», «Организационно-методические аспекты разработки и реализации программ высшего образования по направлениям подготовки Экономика и управление», удостоверение о повышении квалификации, № 612400037487, 29.09.2023 г. 5. ФГАОУ ДПО «Государственная академия промышленного менеджмента им. Н.П. Пастухова», г. Москва, «Формирование системы локальных нормативных актов, регламентирующих деятельность по реализации ДПО в вузах новых субъектов Российской Федерации в целях их интеграции в единое образовательное пространство», удостоверение о повышении квалификации, № 760600044542, 27.12.2023 г. 6. Ассоциация развития финансовой грамотности, г. Москва, «Финансовая культура семьи как основа устойчивого развития экономики», удостоверение о

				повышении квалификации, № 0170-05/2024, 13.05.2024 г. 7. Ассоциация развития финансовой грамотности, г. Москва, «Финансовое просвещение как основа устойчивого развития территории», удостоверение о повышении квалификации, № 0268-08/2024, 12.11.2024 г.

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ
УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.12 УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность
Специализация: - Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности
Трудоемкость учебной дисциплины 4 з.е.
Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине:

знать: этапы развития теории риска; свойства риска; сущность, содержание и классификацию рисков; место качественного и количественного анализа в системе управления риском; классификацию методов анализа рисков; составляющие системы управления рисками; суть стратегий реагирования на риски; инструменты реагирования на риски;

уметь: анализировать во взаимосвязи финансово-экономические явления и процессы, характеризующие внутреннюю и внешнюю среду и делать обоснованные выводы; рассчитывать и интерпретировать результаты расчетов статистических характеристик; использовать современное программное обеспечение для разработки и реализации управленческих решений, а также оценки их эффективности; использовать современные методы организации эффективного риск-менеджмента; проводить анализ чувствительности; оценивать степень воздействия операционного и финансового рычагов; оценивать запас финансовой прочности.

владеть: навыками математико-статистического анализа рисков, анализа чувствительности, расчета ожидаемой и требуемой доходности.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
ПК-2 Способен консультировать по вопросам управления рисками в организации	ИД-1ПК-2 Информирует и консультирует заинтересованные стороны по вопросам управления рисками
	ИД-2ПК-2 Представляет позиции организации в сфере управления рисками

Смысловые модули и темы учебной дисциплины:
Смысловой модуль 1. Сущность и основные теоретические подходы к теории рисков. Тема 1. Понятие о риске и неопределенности. Тема 2. Информационное обеспечение управления рисками. Тема 3. Типология решений и критерии выбора в рисковых ситуациях. Тема 4. Риск и доходность
Смысловой модуль 2. Система управления рисками. Тема 5. Система управления рисками предприятия. Тема 6. Идентификация и качественная оценка рисков. Тема 7. Количественная оценка рисков. Тема 8. Методы реагирования на риски. Тема 9. Мониторинг и контроль рисков

Форма промежуточной аттестации: Экзамен

Разработчик:
Верич Ю.Л., доцент кафедры финансов
и экономической безопасности,
канд. экон. наук, доцент

Заведующая кафедрой финансов
и экономической безопасности:
Омельянович Л. А.,
д-р экон. наук профессор