

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна

Должность: Проректор по учебно-методической работе

Дата подписания: 28.02.2025 22:32:55

Уникальный идентификатор документа:

b066544bae1e449cd8bfce39257274a676a2711b2

**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

(инициалы, фамилия)

2024 г.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.03.02 КОРПОРАТИВНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ

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

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
(наименование)

Институт учета и финансов

Форма обучения, курс:

очная форма обучения, 5 курс

очно-заочная форма обучения, 6 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными возможностями
здоровья и инвалидов

Донецк
2024

Рабочая программа учебной дисциплины «Корпоративные финансовые риски» 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 2024 г. - для очной формы обучения;
- в 2024 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 «21» февраля 2024 года № 21

Зав. кафедрой финансов и экономической безопасности


Л.А. Омелянович
(подпись) БЕЗОПАСИ (инициалы, фамилия)

СОГЛАСОВАНО:

Директор института учета и финансов


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

« 21 » февраля 2024 года

ОДОБРЕНО

Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»

Протокол от «18» февраля 2024 года № 7

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

© Верич Ю.Л., 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

Наименование показателя	Наименование укрупненной группы направлений подготовки, направление подготовки, профиль, программа высшего образования	Характеристика учебной дисциплины	
		очная форма обучения	заочная форма обучения
Количество зачетных единиц – 3	Укрупненная группа специальностей 38.00.00 Экономика и управление специальность 38.05.01 Экономическая безопасность	Часть, формируемая участниками образовательных отношений	
	Специализация: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности	Год подготовки	
5-й		6-й	
Семестр			
9-й		зимняя сессия	
Лекции			
Модулей – 1	Программа высшего образования – программа специалитета	18 часов	8 часов
Смысловых модулей – 2		Практические, семинарские занятия	
Общее количество часов – 108		16 часов	6 часов
		Лабораторные занятия	
		-	-
	Самостоятельная работа		
	72,85 часов	90,55 часов	
	Индивидуальные задания:		
	2 ТМК		
Форма промежуточной аттестации:			
	Зачет	Зачет	

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:
 для очной формы обучения – 34/ 72,85
 для заочной формы обучения – 14/90,55

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель учебной дисциплины: сформировать у обучающихся систему знаний об основах корпоративных финансовых рисков, способах их оценки и методах управления корпоративными финансовыми рисками

Задачи учебной дисциплины: изучить основы управления корпоративными финансовыми рисками предприятия для формирования системного понимания их роли и места в финансовом менеджменте; уяснить типичный профиль финансовых рисков и методы организации эффективного риск-менеджмента в компании с целью разработки практических рекомендаций по его совершенствованию; рассмотреть и практически освоить современные методы выявления, оценки, анализа и снижения финансовых рисков; изучить механизм применения деривативов для управления финансовыми рисками; сформировать понимание влияния поведенческих факторов на принятие решений в области управления финансовыми рисками.

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП ВО

Учебная дисциплина Б1.В.ДВ.03.02 «Корпоративные финансовые риски» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений ООП ВО. Изучается в 9 семестре, вид контроля – Зачет с оценкой.

Для изучения курса «Корпоративные финансовые риски» требуются знания и навыки по следующим дисциплинам: Управление рисками, Финансовый анализ, Финансовая безопасность.

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: 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:**

<i>Код и наименование компетенции</i>	<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции</i>
ПК-1 Способен осуществлять эксплуатацию интегрированной системы управления рисками	ИД-1ПК-1 Анализирует функционирование системы управления рисками
	ИД-2ПК-1 Осуществляет выработку рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками

В результате изучения учебной дисциплины обучающийся должен:

знать: классификацию и характеристики основных видов корпоративных финансовых рисков; сущность, преимущества и ограничения основных стратегий реагирования на финансовые риски; ключевые инструменты управления финансовыми рисками, включая производные финансовые инструменты; принципы и методы интегрированного управления корпоративными финансовыми рисками; основные поведенческие факторы, влияющие на принятие финансовых решений в условиях риска; методы качественного и количественного анализа финансовых рисков, их место и роль в процессе управления.

уметь: анализировать влияние финансово-экономических факторов на финансовые риски; рассчитывать и интерпретировать статистические характеристики финансовых рисков; оценивать доходность и риски финансовых активов и проектов, включая величину различных видов

финансовых рисков; проводить анализ чувствительности, сценарный анализ и стресс-тестирование; оценивать влияние операционного и финансового рычагов, а также запас финансовой прочности.

владеть: методологией комплексного анализа и оценки корпоративных финансовых рисков; навыками самостоятельного выбора и применения инструментов управления финансовыми рисками; навыками интерпретации результатов анализа финансовой устойчивости компании в контексте управления рисками.

МОДУЛЬ 1. КОРПОРАТИВНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ

Смысловой модуль 1. Теоретические и методологические основы корпоративных финансовых рисков.

Тема 1. Теоретические основы финансовых рисков корпорации

Тема 2. Интегрированное управление рисками

Тема 3. Поведенческие финансы и их влияние на принятие финансовых решений

Тема 4. Основы оценки и измерения финансовых рисков

Тема 5. Использование производных финансовых инструментов для управления рисками

Смысловой модуль 2. Управление отдельными видами корпоративных финансовых рисков

Тема 6. Управление рыночными рисками

Тема 7. Управление кредитным риском

Тема 8. Управление риском ликвидности

Тема 9. Операционные финансовые риски

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. Корпоративные финансовые риски												
Смысловой модуль 1. Теоретические и методологические основы корпоративных финансовых рисков.												
Тема 1. Теоретические основы финансовых рисков корпорации	10	1	1	-	-	8	11	1	-	-	-	10
Тема 2. Интегрированное управление рисками	10	1	1	-	-	8	10,55	1	0	-	-	9,55
Тема 3. Поведенческие финансы и их влияние на принятие финансовых решений	10	2	-	-	-	8	10	-	-	-	-	10
Тема 4. Основы оценки и измерения финансовых рисков	13	2	2	-	-	9	12	1	1	-	-	10
Тема 5. Использование производных финансовых инструментов для управления рисками	16	4	4	-	-	8	13	1	1	-	-	11

Итого по смысловому модулю 1	43	6	4	-	-	33	43,55	3	1	-	-	39,55
Смысловой модуль 2. Управление отдельными видами корпоративных финансовых рисков												
Тема 6. Управление рыночными рисками	12	2	2	-	-	8	12	1	1	-	-	10
Тема 7. Управление кредитным риском	12	2	2	-	-	8	12	1	1	-	-	10
Тема 8. Управление риском ликвидности	12	2	2	-	-	8	12	1	1	-	-	10
Тема 9. Операционные финансовые риски	11,85	2	2	-	-	7,85	12	1	1	-	-	10
Итого по смысловому модулю 2	40	8	8	-	-	24	37	3	3	-	-	31
Итого по смысловому модулю 3	23,85	4	4	-	-	15,85	0	3	2	-	-	20
Всего по смысловым модулям	108	18	16	-	-	72,85	108	8	6	-	-	90,55
<i>Катт</i>	<i>0,9</i>	-	-	-	<i>0,9</i>	-	-	-	1,2-	-	<i>1,2</i>	-
<i>ИК</i>	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<i>КЭ</i>	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
<i>Каттэк</i>	<i>0,25</i>	-	-	-	<i>0,25</i>	-	<i>0,25</i>	-	-	-	<i>0,25</i>	-
Всего часов	108	18	16	-	1,15	72,85	108	8	6	-	3,45	90,55

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.	Теоретические основы финансовых рисков корпорации	1	
2.	Интегрированное управление рисками	1	0
3.	Поведенческие финансы и их влияние на принятие финансовых решений		
4.	Основы оценки и измерения финансовых рисков	2	1
5.	Использование производных финансовых инструментов для управления рисками	4	1
6.	Управление рыночными рисками	2	1
7.	Управление кредитным риском	2	1
8.	Управление риском ликвидности	2	1
9.	Операционные финансовые риски	2	1
Всего:		14	6

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ РАБОТ - Не предусмотрены

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

номер п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
1.	Теоретические основы финансовых рисков корпорации	8	10
2.	Интегрированное управление рисками	8	9,55
3.	Поведенческие финансы и их влияние на принятие финансовых решений	8	10
4.	Основы оценки и измерения финансовых рисков	9	10
5.	Использование производных финансовых инструментов для управления рисками	8	11
6.	Управление рыночными рисками	8	10
7.	Управление кредитным риском	8	10
8.	Управление риском ликвидности	8	10
9.	Операционные финансовые риски	7,85	10
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;
- 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)

Вопросы для подготовки к зачету:

1. Раскройте содержание понятия "корпоративные финансовые риски" и их отличие от других видов рисков.
2. Опишите классификацию корпоративных финансовых рисков.
3. Сравните рыночные и кредитные риски, выделите их ключевые характеристики.
4. Охарактеризуйте риски ликвидности и операционные финансовые риски.
5. Объясните взаимосвязь финансовых рисков между собой и с другими бизнес-рисками.
6. Обоснуйте значение управления корпоративными финансовыми рисками для создания стоимости компании.
7. Опишите основные цели управления рисками в контексте корпоративных финансов.
8. Объясните роль риск-менеджмента в принятии финансовых решений.
9. Опишите концепцию интегрированного управления рисками (ERM) и ее применение в корпорациях.
10. Объясните преимущества внедрения ERM для управления финансовыми рисками.
11. Раскройте основные принципы ERM.
12. Охарактеризуйте различные модели и фреймворки ERM.
13. Опишите влияние основных психологических искажений на принятие финансовых решений.
14. Раскройте влияние поведенческих факторов на корпоративные финансы.
15. Объясните поведенческие аспекты управления финансовыми рисками.
16. Опишите основные понятия теории вероятностей, применяемые в оценке финансовых рисков.
17. Раскройте суть статистических методов оценки финансовых рисков.
18. Перечислите качественные методы оценки финансовых рисков.
19. Опишите основные виды производных финансовых инструментов, используемых для управления рисками.
20. Раскройте применение форвардных и фьючерсных контрактов для управления рисками.
21. Объясните принципы использования опционных контрактов для управления рисками.
22. Охарактеризуйте применение свопов в управлении финансовыми рисками.
23. Опишите виды и источники риска процентных ставок.
24. Раскройте понятие и виды валютного риска, включая методы управления.
25. Объясните понятие ценового риска и методы его управления.
26. Опишите основные виды кредитного риска.
27. Раскройте методы оценки кредитного риска заемщика.
28. Опишите виды риска ликвидности.
29. Раскройте основные методы измерения риска ликвидности.
30. Опишите понятие и основные виды операционных финансовых рисков.

Выполнение контрольной работы для заочной формы обучения

1. Исторический обзор становления риск-менеджмента как науки.
2. Кредитный скоринг как инструмент повышения качества риск-менеджмента.
3. Рейтинги как мера финансовых рисков. Эволюция, назначение, применение.
4. Анализ финансовых инструментов инвестирования: соотношение риска и доходности.

5. Методы обоснования ставки дисконтирования.
6. Влияние личностных факторов на проектирование систем управления рисками.
7. Личностные факторы, влияющие на степень риска при принятии управленческих решений
8. Методика построения кривой склонности к риску.
9. Оптимизация процесса систематизации и оценки рисков.
10. Управление финансовыми рисками на основе анализа волатильности.
11. Построение и ведение карт рисков на основе экспертного анализа.
12. Показатель потенциальных потерь портфеля (VaR): достоинства и недостатки.
13. Временной горизонт, уровень доверия и ожидаемая стоимость портфеля.
14. Вклад в риск портфеля отдельных инструментов (Component VaR).
15. Финансовый левэридж и его детерминанты
16. От финансового рычага к оптимизации структуры капитала компании.
17. Методика расчета финансовых рисков с использованием финансовых рычагов.
18. Хеджирование как способ страхования ценового риска.
19. Хеджирование кредитного риска.
20. Портфельный подход в системе управления инвестиционным риском.
21. Аутсорсинг как способ распределения финансового риска.
22. Инструментарий управления кредитным риском.
23. Применение методов контроллинга в целях мониторинга рисков деятельности предприятия.
24. Учет фактора риска при принятии стратегических решений.
25. Риск-контроллинг как подсистема риск-менеджмента.

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)	3	27
- тесты (темы № 1-9)	3	27
- практические задания (темы № 5-9)	3	15
- контрольная работа (ТМК 1) (тема № 5)	15	15
- контрольная работа (ТМК 2) (тема № 9)	16	16
Промежуточная аттестация	Зачет	100/60
Итого за семестр	<i>100</i>	

* 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:		
- коллоквиум (темы 1-9)	3	27
- тесты (темы 1-9)	2	18
- контрольная работа	55	55
Промежуточная аттестация	Зачет	100/60
Итого за семестр	<i>100</i>	

13. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу									Максимальная сумма баллов
Смысловой модуль № 1					Смысловой модуль № 2				
T1	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	100
6	6	6	6	24	9	9	9	25	

Примечание. T1, T2, ... T9 – номера тем соответствующих смысловых модулей

Соответствие государственной шкалы оценивания академической успеваемости

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

Основная:

Основная:

1. Омелянович 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. Омелянович, Ю. Л. Верич; ГОВПО Донец. нац. ун-т. экономики и торговли им. М. Туган-Барановского, финансов. - Донецк: ГОВПО ДонНУЭТ, 2019. - 136 с.Дополнительная

Дополнительная:

1. Гибсон, Роджер Формирование инвестиционного портфеля: Управление финансовыми рисками / Роджер Гибсон. — 2-е изд. — Москва : Альпина Бизнес Букс, 2019. — 280 с. — ISBN 978-5-9614-0775-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/82378.html>
2. Гибсон, Роджер Формирование инвестиционного портфеля: Управление финансовыми рисками / Роджер Гибсон. — 2-е изд. — Москва : Альпина Бизнес Букс, 2019. — 280 с. — ISBN 978-5-9614-0775-4. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/82378.html>

15. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Unilib UC : автоматизир. библиотечная информ. система : версия 2.110 // Научная библиотека Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – Донецк, 2003–. – Режим доступа : для зарегистрир. 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. Информиио : электрон. справочник / ООО «РИНФИЦ». – Москва : Издат. дом «Информиио», [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, сор. 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, сор. 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, сор. 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, сор. 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.

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,	Ученая степень, шифр и наименование научной специальности, ученое звание, какой кафедрой	Повышение квалификации (наименование организации, вид документа, тема, дата выдачи)

		квалификация по диплому)	присвоено, тема диссертации	
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	<p>1. Филиал УГТУ, г. Усинск, «Информационные технологии в образовании», удостоверение о повышении квалификации, № 110400009600, 28.02.2022 г.</p> <p>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.</p> <p>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</p> <p>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.</p> <p>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.</p>

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.ДВ.03.02 КОРПОРАТИВНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ

Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Трудоемкость учебной дисциплины 3 з.е.

Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине:

знать: классификацию и характеристики основных видов корпоративных финансовых рисков; сущность, преимущества и ограничения основных стратегий реагирования на финансовые риски; ключевые инструменты управления финансовыми рисками, включая производные финансовые инструменты; принципы и методы интегрированного управления корпоративными финансовыми рисками; основные поведенческие факторы, влияющие на принятие финансовых решений в условиях риска; методы качественного и количественного анализа финансовых рисков, их место и роль в процессе управления.

уметь: анализировать влияние финансово-экономических факторов на финансовые риски; рассчитывать и интерпретировать статистические характеристики финансовых рисков; оценивать доходность и риски финансовых активов и проектов, включая величину различных видов финансовых рисков; проводить анализ чувствительности, сценарный анализ и стресс-тестирование; оценивать влияние операционного и финансового рычагов, а также запас финансовой прочности.

владеть: методологией комплексного анализа и оценки корпоративных финансовых рисков; навыками самостоятельного выбора и применения инструментов управления финансовыми рисками; навыками интерпретации результатов анализа финансовой устойчивости компании в контексте управления рисками.

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения

<i>Код и наименование компетенции</i>	<i>Код и наименование индикатора достижения компетенции</i>
ПК-1 Способен осуществлять эксплуатацию интегрированной системы управления рисками	ИД-1ПК-1 Анализирует функционирование системы управления рисками
	ИД-2ПК-1 Осуществляет выработку рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками

Смысловые модули и темы учебной дисциплины:

Смысловой модуль 1. Сущность и основные теоретические подходы к теории корпоративных рисков. Тема 1. Теоретические основы финансовых рисков корпорации. Тема 2. Интегрированное управление рисками. Тема 3. Поведенческие финансы и их влияние на принятие финансовых решений. Тема 4. Основы оценки и измерения финансовых рисков

Смысловой модуль 2. Виды корпоративных финансовых рисков. Тема 5. Управление рыночными рисками. Тема 6. Управление кредитным риском. Тема 7. Управление риском ликвидности. Тема 8. Операционные финансовые риски. Тема 9. Использование производных финансовых инструментов для управления рисками

Форма промежуточной аттестации: Зачет

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

