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:
b066544bae1e449cd8bfce393f7224e676a07172

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.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
2025

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 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 № 1
Зав. кафедрой финансов и экономической безопасности

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

СОГЛАСОВАНО:
Директор института учета 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 – 3</td><td>Укрупненная группа специальностей
38.00.00 Экономика и управление</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>5-й</td><td>6-й</td></tr>
<tr><td rowspan="2">Общее количество часов – 108</td><td colspan="2">Семестр</td></tr>
<tr><td>9-й</td><td>Зимняя сессия</td></tr>
<tr><td rowspan="13">Количество часов в неделю для очной формы обучения:
аудиторных – 2;
самостоятельной работы обучающегося – 3,8</td><td rowspan="13">Программа высшего образования – программа специалитета</td><td colspan="2">Лекции</td></tr>
<tr><td>18 часов</td><td>6 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Практические, семинарские занятия</td></tr>
<tr><td>18 часов</td><td>6 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>69,1 часов</td><td>91,1 часов</td></tr>
<tr><td colspan="2">Индивидуальные задания:</td></tr>
<tr><td>2 ТМК</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">Форма промежуточной аттестации:</td></tr>
<tr><td>Зачет с оценкой</td><td>Зачет с оценкой</td></tr>
</table>

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:
для очной формы обучения –36/ 69,1
для заочной формы обучения – 12/91,1

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель учебной дисциплины:_сформировать у слушателей комплекс знаний об основах корпоративных финансовых рисков, способах их оценки и методах снижения корпоративных финансовых рисков.

Задачи учебной дисциплины: - изучение основ управления корпоративными финансовыми рисками предприятия;

- изучение типичного профиля финансовых рисков и методов организации эффективного риск-менеджмента в компании;

- изучение и практическое освоение современных методов выявления, оценки, анализа и снижения финансовых рисков;

- изучение вопросов использования производных финансовых инструментов с целью хеджирования финансовых рисков;
- изучение различных стратегий хеджирования финансовых рисков с использованием производных финансовых инструментов.

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**:

Код и наименование компетенции	*Код и наименование индикатора достижения компетенции*
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
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: место качественного и количественного анализа в системе управления риском; классификацию методов анализа рисков; 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; определять ожидаемую доходность и уровень риска отдельного финансового актива, фондового портфеля и реального инвестиционного проекта; 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.

5. ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. КОРПОРАТИВНЫЕ ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ

Смысловой модуль 1. Сущность и основные теоретические подходы к теории корпоративных рисков

Тема 1. Теоретические основы финансовых рисков корпорации
Тема 2. Исследование финансовых рисков корпораций
Тема 3. Вероятностная оценка рисков
Тема 4. Риск и доходность
Смысловой модуль 2. Виды корпоративных финансовых рисков
Тема 5. Рыночный риск
Тема 6. Валютный риск
Тема 7. Кредитный риск
Смысловой модуль 3. Система управления корпоративными финансовыми рисками
Тема 8. Методы анализа риска
Тема 9. Механизмы управления корпоративными финансовыми рисками

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	СРС
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13
Модуль 1. Корпоративные финансовые риски												
Смысловой модуль 1. Сущность и основные теоретические подходы к теории корпоративных рисков												
Тема 1. Теоретические основы финансовых рисков корпорации	9	1	1	-	-	7	9	1	1	-	-	10
Тема 2. Исследование финансовых рисков корпораций	9	1	1	-	-	7	9,1	0	0	-	-	9,1
Тема 3. Вероятностная оценка рисков	12	2	2	-	-	8	12	1	1	-	-	10
Тема 4. Риск и доходность	12	2	2	-	-	8	12	1	1	-	-	10
Итого по смысловому модулю 1	***42***	***6***	***6***	***-***	***-***	***30***	***45,1***	***3***	***3***	***-***	***-***	***39,1***
Смысловой модуль 2. Виды корпоративных финансовых рисков												
Тема 5. Рыночный риск	16	4	4	-	-	8	12		1	-	-	11
Тема 6. Валютный риск	12	2	2	-	-	8	12	1	1	-	-	10

Тема 7. Кредитный риск	12	2	2	-	-	8	12	1	1	-	-	10
Итого по смысловому модулю 2	***40***	***8***	***8***	***-***	***-***	***24***	***36***	***2***	***3***	***-***	***-***	***31***
Смысловой модуль 3. Система управления корпоративными финансовыми рисками												
Тема 8. Методы анализа риска	12	2	2	-	-	8	13	1	1	-	-	11
Тема 9. Механизмы управления корпоративным и финансовыми рисками	11,1	2	2	-	-	7,1	11		1	-	-	10
Итого по смысловому модулю 3	***23,1***	***4***	***4***	***-***	***-***	***15,1***	***0***	***3***	***2***	***-***	***-***	***21***
Всего по смысловым модулям	**105,1**	**18**	**18**	**-**	**-**	**69,1**	**108**	**6**	**8**	**-**	**-**	**91,1**
Катт	***2,9***	-	-	-	***2,9***	-		-	0,9-	-	***0,9***	-
СРэк		-	-	-				-	-	-		-
ИК		-	-	-		-	***0***	-	-	-	0	-
КЭ		-	-	-		-	***0***	-	-	-	***0***	-
Каттэк		-	-	-		-	***2***	-	-	-		-
Контроль							**2**				**2**	
Всего часов	**108**	**18**	**18**	-	**2,9**	**69,1**	**108**	**6**	**6**	-	***4,9***	**91,1**

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	1
2.	Исследование финансовых рисков корпораций	1	0
3.	Вероятностная оценка рисков	2	1
4.	Риск и доходность	2	1
5.	Рыночный риск	4	1
6.	Валютный риск	2	1
7.	Кредитный риск	2	1
8.	Методы анализа риска	2	1
9.	Механизмы управления корпоративными финансовыми рисками	2	1
Всего:		18	0

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	7	10
2.	Исследование финансовых рисков корпораций	7	9,1
3.	Вероятностная оценка рисков	8	10
4.	Риск и доходность	8	10
5.	Рыночный риск	8	11
6.	Валютный риск	8	10
7.	Кредитный риск	8	10
8.	Методы анализа риска	8	11
9.	Механизмы управления корпоративными финансовыми рисками	7,1	10
Всего:		69,1	91,1

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)

1. Эволюция теории риска.
2. Риск как финансово-экономическая категория.
3. Основы управления рисками.
4. Стандартизация управления рисками
5. Информация как основа для исследования рисков.
6. Требования к качеству информации и его оценка.
7. Определенные и случайные величины.
8. Распределение случайных величин.
9. Требуемая доходность и ее использование для учета изменения стоимости денег во времени.
10. Учет риска при обосновании требуемой доходности.
11. Ожидаемая доходность.
12. Кривая безразличия.
13. Измерение рыночного риска.
14. Диверсификация инвестиционного портфеля.
15. Модель CAMP
16. Понятие валютного риска и его виды.
17. Учет инфляционного и валютного рисков в ставке дисконтирования.
18. Методы управления валютным и инфляционным риском
19. Кредитный риск и его оценка.
20. Рейтинговые агентства оценки рисков.
21. Измерение кредитных рисков.
22. Скоринговая модель оценки вероятности банкротства контрагента.
23. Качественный анализ рисков.
24. Индикативный анализ.
25. Оценка операционного рычага.
26. Оценка финансового рычага.
27. Методы количественного анализа рисков.
28. Система управления рисками.
29. Инструменты реагирования на риски.
30. Стратегии реагирования на риски.

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 леверидж 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)	2	18
- практические задания (темы № 3-8)	4	24
- контрольная работа (ТМК 1) (тема № 4)	5	10
- контрольная работа (ТМК 2) (тема № 7)	5	10
- контрольная работа (ТМК 3) (тема № 9)	5	11
Промежуточная аттестация	Зачет с оценкой	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:		
- коллоквиум (темы 1-9)	3	27
- тесты (темы 1-9)	2	18
- контрольная работа	55	55

Промежуточная аттестация	Зачет с оценкой	100/60
Итого за семестр	*100*	

Вопросы для подготовки к зачету:

1. Финансовый риск и какие виды финансовых рисков.
2. Методы оценки финансовых рисков
3. Портфель инвестиций и финансовые риски
4. Факторы, влияющие на финансовые риски корпорации
5. Какие инструменты и стратегии используются для управления финансовыми рисками?
6. Что такое диверсификация портфеля и как она помогает снизить финансовые риски?
7. Что такое финансовая модель и как она используется для анализа финансовых рисков?
8. Что такое финансовый кризис и какие последствия он имеет для корпораций и экономики в целом?
9. Какие основные принципы и нормы регулируют финансовую деятельность корпораций?
10. Что такое бюджетирование и как оно связано с финансовыми рисками?
11. Какие риски связаны с инвестированием в ценные бумаги и как их измерять?
12. Какие риски связаны с кредитованием и как их управлять?
13. Какие риски связаны с валютными операциями и как их минимизировать?
14. Какие риски связаны с проектным финансированием и как их оценивать?
15. Какие риски связаны с финансовой инновацией и как их контролировать?
16. Какие риски связаны с финансовой отчетностью и как их проверять?
17. Какие риски связаны с финансовым аудитом и как их устранять?
18. Какие риски связаны с финансовым контролем и как их осуществлять?
19. Какие риски связаны с финансовым планированием и как их учитывать?
20. Какие риски связаны с финансовой стратегией и как их формировать?

13. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Текущее тестирование и самостоятельная работа, балл									**Сумма, балл**
Смысловой модуль № 1				**Смысловой модуль № 2**			**Смысловой модуль № 3**		
Т1	Т2	Т3	Т4	Т5	Т6	Т7	Т8	Т9	100
5	5	9	19	9	9	19	9	20	

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

Соответствие государственной шкалы оценивания академической успеваемости и шкалы ECTS

По шкале ECTS	**Сумма баллов за все виды учебной деятельности**	**По государственной шкале**	**Определение**
A	90-100	«Отлично» (5)	отлично – отличное выполнение с незначительным количеством неточностей
B	80-89	«Хорошо» (4)	хорошо – в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 10 %)

C	75-79		хорошо – в целом правильно выполненная работа с незначительным количеством ошибок (до 15 %)
D	70-74	«Удовлетворительно» (3)	удовлетворительно – неплохо, но со значительным количеством недостатков
E	60-69		удовлетворительно – выполнение удовлетворяет минимальные критерии
FX	35-59	«Неудовлетворительно» (2)	неудовлетворительно – с возможностью повторной аттестации
F	0-34		неудовлетворительно – с обязательным повторным изучением дисциплины (выставляется комиссией)

14. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная:

1. 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.Дополнительная

Дополнительная:

1. Гибсон, Роджер Формирование инвестиционного портфеля: Управление финансовыми рисками / Роджер Гибсон. — 2-е изд. — Москва : Альпина Бизнес Букс, 2019. — 280 c. — 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 c. — 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. библ. информ. система : версия 2.110 // Научная библиотеки 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. 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, 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, 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.

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. Сертификат о повышении квалификации №0164 от 15.02.2019 г., «Комплексное сопровождение образовательного процесса обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья», 16 часов, Государственная организация высшего

				профессионального образования «ДонНУЭТ имени Михаила Туган-Барановского». 2. Удостоверение о повышении квалификации №110400005411 от 25.02.2020 г., «Проектирование образовательного процесса в высшей школе на деятельностной основе», 72 часа, Филиал Ухтинского государственного технического университета, г. Усинск 3. Удостоверение о повышении квалификации №110400009600 от 28.02.2022г., «Информационные технологии в образовании», 72 часа, Филиал Ухтинского государственного технического университета, г. Усинск 4. Удостоверение о повышении квалификации № 771802829939 от 27.05.2022г., «Работа в электронной информационно-образовательной среде», 16 часа, Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова», г. Москва Программа повышения квалификации «Актуальные вопросы преподавания в образовательных учреждениях высшего образования: нормативно-правовое психолого-педагогическое и методическое сопровождение», 2022 г., 24 часа, ФГБОУВО «ДГТУ» () 2022/0326

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: место качественного и количественного анализа в системе управления риском; классификацию методов анализа рисков; 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; определять ожидаемую доходность и уровень риска отдельного финансового актива, фондового портфеля и реального инвестиционного проекта; 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.

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-1ПК-1 Анализирует функционирование системы управления рисками
	ИД-2ПК-1 Осуществляет выработку рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками
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 корпоративных рисков. Тема 1. Теоретические основы финансовых рисков корпорации. Тема 2. Исследование финансовых рисков корпораций. Тема 3. Вероятностная оценка рисков. Тема 4. Риск и доходность
Смысловой модуль 2. Виды корпоративных финансовых рисков. Тема 5. Рыночный риск. Тема 6. Валютный риск. Тема 7. Кредитный риск. Тема 8. Методы анализа риска. Тема 9. Механизмы управления корпоративными финансовыми рисками
Смысловой модуль 3. Система управления корпоративными финансовыми рисками..

Форма промежуточной аттестации: Зачет с оценкой

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