

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Крылова Людмила Вячеславовна
Должность: Проректор по учебно-методической работе
Дата подписания: 01.09.2026 13:53:51
Уникальный программный ключ:
b066544bae10440cd8bfee392f7234a676a271b2

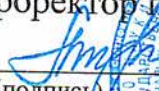
**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**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) (фамилия, инициалы)

«25» марта 2026 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
Б.1.В.ДВ.03.01 МОДЕЛИРОВАНИЕ И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ
ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ДЕЯТЕЛЬНОСТИ**

(шифр, название дисциплины)

Углубленная	группа	38.00.00 Экономика и управление
направлений подготовки		
Образовательная		<u>программа специалитета</u>
программа	высшего	
образования		
Специальность		<u>38.05.01 Экономическая безопасность</u>
Специализация		<u>Экономико-правовое обеспечение экономической</u> <u>безопасности</u>
Институт		<u>учета и финансов</u>
Форма обучения, курс		очная форма обучения, 5 курс заочная форма обучения, 6 курс

Рабочая программа адаптирована для лиц с ограниченными возможностями
здоровья и инвалидов

Донецк
2026

Рабочая программа дисциплины «Моделирование и управление рисками экономической деятельности» для обучающихся по специальности 38.05.01 Экономическая безопасность, специализации: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности разработана в соответствии с ОПОП ВО для набора обучающихся 2026 года

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

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры финансов и экономической безопасности

Протокол от «18» 02 2026 года № 20

Зав. кафедрой



СОГЛАСОВАНО

Директор института учета и финансов

Л.И. Тымчина



« 24 » 02 2026 года

ОДОБРЕНО

Учебно-методическим советом ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ»

Протокол от «25» марта 2026 года № 9

Председатель Крылова Л.В.

© Малецкий А.В., 2026 год

© Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Донецкий национальный университет экономики и торговли имени Михаила Туган-Барановского», 2026 год

1. ОПИСАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование показателя	Наименование укрупненной группы направлений подготовки/ специальностей, направление подготовки/ специальность, профиль/ специализация/ магистерская программа, программа высшего образования	Характеристика дисциплины	
		очная форма обучения	заочная/ очно-заочная форма обучения
Количество зачетных единиц – 3	Укрупненная группа специальностей 38.00.00 Экономика и управление	Базовая	
	Специальность 38.05.01 Экономическая безопасность		
Модулей – 1	Специализация: №1 Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности	Год подготовки	
Смысловых модулей – 3		5-й	6-й
Общее количество часов – 108		Семестр	
		9-й	Зимняя сессия
		Лекции	
		16 час.	6 часов
Количество часов в неделю для очной формы обучения: аудиторных – 1,7; самостоятельной работы обучающегося – 4,5	Программа высшего образования – программа специалитета	Практические и семинарские занятия	
		14 часов	4 часов
		Лабораторные занятия	
		-	-
		Самостоятельная работа	
		76,95 часов	94,85 часов
		Форма промежуточной аттестации:	
	зачёт (0,25 час.)	зачёт (0,25 час.)	

Соотношение количества часов аудиторных занятий и самостоятельной работы составляет:

для очной формы обучения – 30 / 76,95

для заочной формы обучения – 10 / 94,85

2. ЦЕЛЬ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

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

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

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Дисциплина Б.1.В.ДВ.03.01 «Моделирование и управление рисками экономической деятельности» относится к вариативной части, формируемой участниками образовательных отношений ОПОП ВО.

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

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

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

В результате освоения 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 Информировует 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: - основные термины и понятия дисциплины; основные виды рисков, их особенности; методы и модели анализа финансовых рисков.

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

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

5. ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

МОДУЛЬ 1. Моделирование и управление рисками экономической деятельности

Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков

Тема 1. Сущность, содержание и виды риска

Тема 2. Риск в инвестировании капитала

Смысловой модуль 2. Моделирование и оценка финансовых рисков

Тема 3. Финансовое прогнозирование на основе линейных регрессионных моделей

Тема 4. Оценка предпринимательских рисков

Тема 5. Экспертный метод анализа риска

Тема 6. Анализ риска методом имитационного моделирования Монте-Карло

Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска

Тема 7. Страхование – основной прием риск – менеджмента

Тема 8. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и риска

Тема 9. Запасы и резервы как способы снижения риска

6. СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Название смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма обучения						заочная/очно-заочная форма обучения					
	всего	в том числе					всего	в том числе				
		л ¹	п ²	лаб ³	СР ⁴	Пр ⁵		л	п	лаб	СР	Пр
Модуль 1. Моделирование и управление рисками экономической деятельности												
Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков												
Тема 1. Сущность, содержание и виды риска	11	1	1		9		11	0,5	-		11	
Тема 2. Риск в инвестировании капитала	11	1	1		9		11	0,5	0,5		11	
Итого по смысловому модулю 1	22	2	2		18		22	1	0,5		22	
Смысловой модуль 2. Моделирование и оценка финансовых рисков												
Тема 3. Финансовое прогнозирование на основе линейных регрессионных моделей	12	2	1		9		12	0,5	0,5		11	
Тема 4. Оценка предпринимательских рисков	12	2	1		9		12	0,5	0,5		11	
Тема 5. Экспертный метод анализа риска	12	2	2		8		12	0,5	0,5		11	
Тема 6. Анализ риска методом имитационного моделирования Монте-Карло	12	2	2		8		12	0,5	0,5		11	
Итого по смысловому модулю 2	48	8	6		34		48	2	2		44	
Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска												
Тема 7. Страхование – основной прием риск – менеджмента	12	2	2		8		11	1	0,5		9,5	
Тема 8. Портфель ценных бумаг:	12	2	2		8		11	1	0,5		9,5	

Название смысловых модулей и тем	Количество часов											
	очная форма обучения						заочная/очно-заочная форма обучения					
	всего	в том числе					всего	в том числе				
		л ¹	п ²	лаб ³	СР ⁴	Пр ⁵		л	п	лаб	СР	Пр
оценка доходности и риска												
Тема 9. Запасы и резервы как способы снижения риска	12,95	2	2		8,95		12,85	1	0,5		11,35	
Итого по смысловому модулю 3	36,95	6	6		24,95		34,85	3	1,5		30,35	
Всего часов	106,95	16	14		76,95		104,85	6	4		94,85	
ИК												
Катт						0,8						0,9
СРэк												
КЭ												
Каттэк						0,25						0,25
Контроль												2
Итого	108	16	14		76,95	1,05	108	6	4		94,85	3,15

Примечания: 1. л – лекции;

2. п – практические (семинарские) занятия;

3. лаб – лабораторные занятия;

4. СР – самостоятельная работа;

5. Пр – прочие виды работы (ИК, Катт, КЭ, Каттэк)

6. ИК – индивидуальные консультации;

7. Катт – контактная работа на аттестацию в период теоретического обучения;

8. СРэк – самостоятельная работа в период экзаменационных сессий;

9. КЭ – консультации перед экзаменом

10. Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий.

7. ТЕМЫ СЕМИНАРСКИХ И ПРАКТИЧЕСКИХ ЗАНЯТИЙ

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков			
1	Тема 1. Сущность, содержание и виды риска	1	-
2	Тема 2. Риск в инвестировании капитала	1	0,5
Смысловой модуль 2. Моделирование и оценка финансовых рисков			
3	Тема 3. Финансовое прогнозирование на основе линейных регрессионных моделей	1	0,5
4	Тема 4. Оценка предпринимательских рисков	1	0,5
5	Тема 5. Экспертный метод анализа риска	2	0,5
6	Тема 6. Анализ риска методом имитационного моделирования Монте-Карло	2	0,5
Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска			
7	Тема 7. Страхование – основной прием риск – менеджмента	2	0,5
8	Тема 8. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и риска	2	0,5
9	Тема 9. Запасы и резервы как способы снижения риска	2	0,5
ВСЕГО		14	4

8. ТЕМЫ ЛАБОРАТОРНЫХ ЗАНЯТИЙ – не предусмотрены

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

9. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА

№ п/п	Название темы	Количество часов	
		очная форма	заочная форма
Смысловой модуль 1. Теоретические основы финансовых рисков			
1	Тема 1. Сущность, содержание и виды риска	9	10,5
2	Тема 2. Риск в инвестировании капитала	9	10
Смысловой модуль 2. Моделирование и оценка финансовых рисков			
3	Тема 3. Финансовое прогнозирование на основе линейных регрессионных моделей	9	11
4	Тема 4. Оценка предпринимательских рисков	9	11
5	Тема 5. Экспертный метод анализа риска	8	11
6	Тема 6. Анализ риска методом имитационного моделирования Монте-Карло	8	11
Смысловой модуль 3. Риски и менеджмент, способы снижения риска			
7	Тема 7. Страхование – основной прием риск – менеджмента	8	9,5
8	Тема 8. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и риска	8	9,5
9	Тема 9. Запасы и резервы как способы снижения риска	8,95	11,35
ВСЕГО		76,95	94,85

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

В ходе реализации дисциплины используются такие 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, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
- письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением или могут быть заменены устным ответом;
- при необходимости предоставляется увеличивающее устройство; возможно также использование собственных увеличивающих устройств;
- письменные задания оформляются увеличенным шрифтом...

2) для глухих и слабослышащих:

- лекции оформляются в виде электронного документа, либо предоставляется звукоусиливающая аппаратура индивидуального пользования;
- письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
- зачет, экзамен проводятся в письменной форме на компьютере; возможно проведение их в форме тестирования...

3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- лекции оформляются в виде электронного документа, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
- письменные задания выполняются на компьютере со специализированным программным обеспечением;
- зачет, экзамен проводятся в устной форме или выполняется в письменной форме на компьютере...

При необходимости предусматривается увеличение времени для подготовки ответа.

Процедура проведения зачета, экзамена для обучающихся устанавливается с учетом их индивидуальных психофизических особенностей.

Зачет, экзамен могут проводиться в несколько этапов.

При проведении процедуры оценивания результатов обучения предусматривается использование технических средств, необходимых в связи с индивидуальными особенностями обучающихся. Технические средства могут быть предоставлены ФГБОУ ВО «ДОННУЭТ», а также могут использоваться собственные технические средства.

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

Обеспечивается доступ к информационным и библиографическим ресурсам в информационно-телекоммуникационной 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;
- в форме аудиофайла.

2) для глухих и слабослышащих:

- в печатной форме;
- в форме электронного документа;

3) для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

- в печатной форме;
- в форме электронного документа;
- в форме аудиофайла.

11. СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

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

Система оценивания по дисциплине, изучаемой в очной форме обучения¹

Форма контроля	Максимальное количество баллов	
	За одну работу	Всего
Текущий контроль		
– дискуссия, собеседование (темы № 1,2, 11,12)	6	60
– разноуровневые задачи и задания (темы № 3-10)	6	20
– текущий модульный контроль (тест)	6	20
Промежуточная аттестация	дифференцированный зачет	100
Итого за семестр	100	

Примечание. В соответствии с утвержденными оценочными материалами по дисциплине

Система оценивания по дисциплине, изучаемой в заочной/ очно-заочной форме обучения

Форма контроля	Максимальное количество баллов	
	За одну работу	Всего
Текущий контроль		
– тестирование	6	30
– контрольная работа	40	40
– разноуровневые задачи и задания	6	30
Промежуточная аттестация	дифференцированный зачет	100
Итого за семестр	100	

Вопросы для подготовки к зачёту:

- Соотношение эффективности и риска в предпринимательской деятельности.
- Инновационная предпринимательская деятельность и риск.
- Из истории возникновения и развития предпринимательства как рискованной формы деятельности.
- Предпринимательский риск и собственность.
- Эволюция отношения к феномену предпринимательского риска.
- Развитие изучения роли предпринимательского риска в российской экономике.
- Риски, вызванные организационной структурой производства и управления.
- Риск, обусловленный поведением конкурентов.
- Риск неоптимального распределения ресурсов.
- Специальные виды потерь.
- Возможность прогнозирования случайных видов потерь.
- Качественная оценка уровней потерь.
- Особенности расчетно-аналитического способа построения кривой риска.
- Финансовая деятельность и зоны риска.
- Рисковая функция страхования.
- Современная портфельная теория.
- Оценка риска инвестиционного проекта на практике.
- Стратегия и тактика в управлении предпринимательским риском.
- Риск-менеджмент и практика.
- Риск-менеджмент как самостоятельная форма предпринимательской деятельности.
- Управление банковскими рисками.
- Сферы возникновения банковских рисков.
- Хеджирование, как метод снижения степени финансовых рисков.
- Валютный рынок и развития международной финансово-кредитной системы.
- Валютный риск и развитие международных рыночных отношений.
- Факторы, определяющие финансово-кредитный риск *страны*.
- Риск иностранного кредитования и его отличие от риска прямых иностранных инвестиций.
- Финансово-кредитный риск в международных отношениях.
- Влияние предпринимательского риска на развитие научно-технического прогресса.
- Предпринимательский риск и развитие законодательной системы.
- Предпринимательский риск как инструмент воздействия на рыночную экономику.
- Риски при вложении ценных бумаг.
- Способы минимизации банковских рисков.

34. Стратегический менеджмент и управление рисками.
35. Метод экспертных оценок и метод делфи.
36. Статистический метод, Value at Risk (VaR), метод Монте-Карло.
37. История возникновения прогнозирования рисков как науки.
38. Общенаучные подходы к управлению рисками на предприятии.
39. Специальные методы в управлении рисками.
40. Риск-менеджмент на предприятии.
41. Страхование как способ минимизации риска.
42. Самострахование и внутренние резервы предприятия как способ снижения риска.
43. Методы математического моделирования рисков.
44. Оценка рисков с применением вычислительной техники.
45. Анализ рисков и максимизация прибыли предприятия.
46. 45.Риск-менеджмент необходимость при ведении хозяйственной деятельности.
47. Риск как обязательный элемент экономической деятельности.
48. Риски связанные с использованием венчурного капитала.
49. Построение дерева решений для принятия решений в рискованных ситуациях.
50. Методы прогнозирования при оптимизации внутренних запасов.
51. Суть модели М. Миллера и Д. Орра при управлении рисками.
52. Актуальность страхования при управлении рисками.
53. Венчурный капитал или рискованные инвестиции.
54. Степень риска при венчурном капитале.
55. Предпринимательский риск как инструмент воздействия на рыночную экономику.
56. Графические методы определения риска.
57. Метод наименьших квадратов как один из точных в прогнозировании рисков.
58. Теория игр и случайные величины при прогнозировании риска.
59. Компьютерное моделирование риска.
60. Методы оценки и минимизации предпринимательских рисков.
61. Графические методы принятия решений в рискованных ситуациях.
62. Внутренние и внешние риски предприятия как неотъемлемая составляющая ведения предпринимательства.

12. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Максимальное количество баллов за текущий контроль и самостоятельную работу									Максимальная сумма баллов
Смысловой модуль 1		Смысловой модуль 2				Смысловой модуль 3			
T1 ¹	T2	T3	T4	T5	T6	T7	T8	T9	100
10	10	10	10	10	10	10	10	20	

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

Государственная шкала оценивания академической успеваемости

Сумма баллов за все виды учебной деятельности	По государственной шкале
90-100	5 «отлично» / «зачтено»
75-89	4 «хорошо» / «зачтено»
60-74	3 «удовлетворительно» / «зачтено»
менее 60	2 «неудовлетворительно» / «не зачтено»

13. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

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

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

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

Дополнительная литература:

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

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

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

4. Токтошов, Г. Ы. Финансовая математика : учебное пособие / Г. Ы. Токтошов. — Новосибирск : Сибирский государственный университет телекоммуникаций и информатики, 2019. — 131 с. — ISBN 2227-8397. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/90603.html>

5. Лай, Чжун Элементарный курс теории вероятностей. Стохастические процессы и финансовая математика / Кай Чжун Лай, АитСахлиа Фарид ; перевод М. Б. Лагутин. — 3-е изд. — Москва : Лаборатория знаний, 2017. — 456 с. — ISBN 978-5-00101-524-6. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/89018.html>

6. Ю-Дау, Люу Методы и алгоритмы финансовой математики / Люу Ю-Дау ; под редакцией Е. В. Чепурина ; перевод С. В. Жуленев. — 3-е изд. — Москва : Лаборатория знаний, 2017. — 752 с. — ISBN 978-5-00101-519-2. — Текст : электронный // Электронно-библиотечная система IPR BOOKS : [сайт]. — URL: <http://www.iprbookshop.ru/89017.html>

7. Экономика биржевой торговли [Электронный ресурс]: учеб. пособие / И. В. Ковалева, Е. С. Кравченко; М-во образования и науки ДНР, Гос. орг. высш. проф. образования "Донец. нац. ун-т экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского", Каф. экономики предприятия. — Донецк: ДонНУЭТ, 2016. — Локал. компьютер. сеть НБ ДонНУЭТ.

Учебно-методические издания:

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

14. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. Автоматизированная интегрированная библиотечная система (АИБС) «МегаПро». - Москва : ООО «Дата Экспресс», 2024-. - Текст : электронный.
2. Электронная библиотека Научной библиотеки Донецкого национального университета экономики и торговли им. Михаила Туган-Барановского. – Донецк : НБ ДОННУЭТ, 2024 – . - URL: <http://192.168.41.108/megapro>. – Текст : электронный.
3. 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 авторизованных пользователей. - Текст. Аудио. Изображения : электронные.
4. Лань : электронная-библиотечная система. - Санкт-Петербург : Лань, сор. 2011-2024. - URL: <https://e.lanbook.com/>- Режим доступа: для авторизованных пользователей. - Текст : электронный.
5. СЭБ : Консорциум сетевых электронных библиотек / Электронная-библиотечная система «Лань» при поддержке Агентства стратегических инициатив. - Санкт-Петербург : Лань, сор. 2011-2024. - URL: <https://seb.e.lanbook.com/> - Режим доступа : для пользователей организаций - участников, подписчиков ЭБС «Лань». - Текст : электронный.
6. Polpred : электронная библиотечная система : деловые статьи и интернет-сервисы / ООО «Полпред Справочники». - Москва : Полпред Справочники, сор. 1997-2024. - URL: <https://polpred.com>. - Текст : электронный.
7. Book on lime : дистанционное образование : электронная библиотечная система / издательство КДУ МГУ им. М.В. Ломоносова. - Москва : КДУ, сор. 2017 -. - URL: <https://bookonline.ru>. - Текст . Изображение. Устная речь : электронные.
8. Информио : электронный справочник / ООО «РИНФИЦ». - Москва : Издательский дом «Информио», 2009 -. - URL: <https://www.informio.ru>. - Текст : электронный.
9. Университетская библиотека онлайн : электронная библиотечная система. – ООО «Директ-Медиа», 2006-. - URL: <https://biblioelub.ru/> - Режим доступа: для авторизованных пользователей. - Текст : электронный.
10. ZNANIUM : электронно-библиотечная система / ООО «ЗНАНИУМ». – Москва : Знаниум, 2021-. - URL: <https://znanium.ru/> – Режим доступа: для авторизир. 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://jiber.rea.ru/login.php>. - Режим доступа: для авторизованных пользователей. - Текст : электронный.
12. Библиотечно-информационный комплекс / Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации. — Москва : Финансовый университет, 2019—. - URL: <http://library.la.ru/> - Режим доступа: для авторизованных пользователей. - Текст : электронный.
13. Зональная научная библиотека имени Ю.А. Жданова / Южный федеральный университет. - Ростов-на-Дону : Южный федеральный университет, 2016 - . - URL: <https://librarv.lib.sfedu.ru/> - Режим доступа: для авторизованных пользователей. - Текст : электронный.
14. Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU: информационно- аналитический портал / ООО Научная электронная библиотека. - Москва : ООО Научная электронная библиотека, сор. 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 «Итеос»]. - 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 :

15. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

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

16. КАДРОВОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

ФИО педагогического (научно-педагогического) работника, участвующего в реализации образовательной программы	Условия привлечения (по основному месту работы, на условиях внутреннего/ внешнего совместительства; на условиях договора гражданско-правового характера (далее – договор ГПХ)	Должность, ученая степень, ученое звание	Уровень образования, наименование специальности, направления подготовки, наименование присвоенной квалификации	Сведения о дополнительном профессиональном образовании ¹
Малецкий Антон Викторович	По основному месту работы	Должность – доцент, кандидат экономических наук, ученое звание доцент	Высшее, менеджмент организаций, магистр, диплом кандидата экономических наук ДК № 019737	1. Удостоверение о повышении квалификации №612400030707 от 19.05.2023г., «Организационно-методические аспекты разработки и реализации программ высшего образования по направлениям подготовки Экономика и управление», 36 часов, ФГБОУ ВО "Донской государственный технический университет", Ростов-на-Дону. 2. Сертификат о повышении квалификации б/н от 02.01.2025г., «Эффективная цифровая и коммуникационная среда преподавателя: синергия законодательных требований и цифровых инструментов», 72 часа, ООО Компания «Ай Пи Ар Медиа», г. Москва.

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

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

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

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

Компетенции выпускников и индикаторы их достижения:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции
ПК-1 Способен осуществлять эксплуатацию интегрированной системы управления рисками.	ИД-1 _{ПК-1} Анализирует функционирование системы управления рисками ИД-2 _{ПК-1} Осуществляет выработку рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками
ПК-2 Способен консультировать по вопросам управления рисками в организации	ИД-1 _{ПК-2} Информировует и консультирует заинтересованные стороны по вопросам управления рисками ИД-2 _{ПК-2} Представляет позиции организации в сфере управления рисками

Наименование смысловых модулей и тем учебной дисциплины:

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

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

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

Форма промежуточной аттестации: зачёт

Разработчик/Разработчики:

Малецкий А.В., кандидат экономических наук, доцент

Заведующий кафедрой финансов и экономической безопасности

Омельянович Л.А., доктор экономических наук, профессор

КАФЕДРА
ФИНАНСОВ И
ЭКОНОМИЧЕСКОЙ
БЕЗОПАСНОСТИ