

Министерство сельского хозяйства Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«ВОРОНЕЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ
ИМПЕРАТОРА ПЕТРА I»

УТВЕРЖДАЮ
И.о. декана экономического факультета
Агибалов А.В.
«24» апреля 2017г.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

ПО ДИСЦИПЛИНЕ Б1.В.ОД.9 «ФИНАНСОВЫЙ РИСК-
МЕНЕДЖМЕНТ»

для направления 38.03.01 «Экономика» - академический бакалавриат,
профиль «Финансы и кредит»

квалификация (степень) выпускника _____ бакалавр

Факультет _____ экономический

Кафедра _____ финансов и кредита

| Форма обучения | Всего зач.ед./ часов | Курс | Семестр | Лекции | Семинарские занятия | Практические занятия | Лабораторные занятия | Курсовая работа (проект), (указать семестр) | Самостоятельная работа | Зачет (указать семестр) | Экзамен (указать семестр/часы) |
|----------------|----------------------|------|---------|--------|---------------------|----------------------|----------------------|---|------------------------|-------------------------|--------------------------------|
| очная | 2/72 | 3 | 6 | 20 | - | 38 | - | - | 14 | 6 | - |
| заочная | 2/72 | 4 | 7 | 8 | - | 6 | - | - | 58 | 7 | - |

Преподаватель: доцент _____ А.А. Орехов



Рабочая программа составлена в соответствии с Федеральным Государственным образовательным стандартом высшего профессионального образования по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» (Приказ Министерства образования и науки РФ от 12.11.2015 г. N 1327).

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры финансов и кредита (протокол №5 от 11.12.2015г.).

Заведующий кафедрой _____  _____ Агибалов А.В.

Рабочая программа рекомендована к использованию в учебном процессе методической комиссией экономического факультета (протокол № 2 от 19.04.2017 г.).

Председатель методической комиссии _  ___ Запорожцева Л.А.

1. Предмет. Цели и задачи дисциплины, её место в учебном процессе

Целью дисциплины является получение бакалаврами теоретических знаний о рисках в хозяйственно-финансовой деятельности и практических навыков финансового риск-менеджмента.

Предметом изучения дисциплины являются финансовые риски в различных проявлениях и система управления ими на предприятиях.

Задачи изучения дисциплины:

- получить представление о научных подходах к изучению и интерпретации экономических рисков, составляющих содержание финансово-хозяйственной деятельности, выборе наиболее рациональных способов управления ими;
- обеспечить бакалавров комплексом знаний, необходимых для организации процессов управления различными видами финансовых рисков;
- приобрести навыки работы в малом коллективе, выработки общих решений в условиях неопределенности и риска.

Данная дисциплина относится к Вариативной части, Обязательные дисциплины. Для успешного освоения данной дисциплины студенты должны овладеть знаниями дисциплин: «Макроэкономика», «Микроэкономика», «Финансы», «Корпоративные финансы», «Деньги, кредит, банки». В свою очередь, изучение финансового риск-менеджмента позволит глубже понять современные механизмы финансового менеджмента, менеджмента предприятий.

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

| Компетенция | | Планируемые результаты обучения |
|-------------|--|---|
| Код | Название | |
| ОК | Общекультурные компетенции | |
| ОК-3 | способность использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности | знать: закономерности функционирования современной экономики на макро- и микроуровне; основы построения, расчета и анализа современной системы показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов на микро- и макроуровне; основные особенности российской экономики, ее институциональную структуру, направления экономической политики государства. |
| ОПК | общепрофессиональные компетенции | |
| ОПК-3 | способность выбрать инструментальные | • знать инструменты и стратегии снижения рисков; |

| | | |
|------|---|---|
| | <p>средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы</p> | <ul style="list-style-type: none"> • уметь находить и использовать информацию о функционировании финансовых рынков, рынков товаров и услуг, необходимую для принятия рискованного решения; • иметь навыки применения информационных технологий для решения управленческих задач. |
| ПК | <p>профессиональные компетенции</p> | |
| ПК-1 | <p>способность собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов</p> | <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> анализировать во взаимосвязи экономические явления, процессы и институты на микро- и макроуровне; выявлять проблемы экономического характера при анализе конкретных ситуаций, предлагать способы их решения с учетом критериев социально-экономической эффективности, оценки рисков и возможных социально-экономических последствий; анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений; |
| ПК-2 | <p>способность на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов</p> | <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономически данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы; прогнозировать на основе стандартных теоретических и эконометрических моделей поведение экономических агентов, развитие экономических процессов и явлений, на микро- и макроуровне; организовать выполнение конкретного порученного этапа работы. |
| ПК-5 | <p>способность анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности,</p> | <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономически данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы; прогнозировать на основе стандартных теоретических и эконометрических моделей поведение экономических агентов, развитие экономических процессов и явлений, на микро- и макроуровне; |

| | | |
|--|---|---|
| | организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений | организовать выполнение конкретного порученного этапа работы. |
|--|---|---|

3. Объем дисциплины и виды учебной работы

| Виды учебной работы | Очная форма обучения | Заочная форма обучения |
|---|----------------------|------------------------|
| | Всего часов | всего часов |
| | | Полная |
| Общая трудоемкость дисциплины | 72 | 72 |
| Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) всего, в т.ч. | 58 | 14 |
| Аудиторная работа | 58 | 14 |
| Лекции | 20 | 8 |
| Практические занятия | 38 | 6 |
| Семинары | - | - |
| Лабораторные работы | - | - |
| Другие виды аудиторных занятий | - | - |
| Самостоятельная работа обучающихся, час, в т.ч. | 14 | 58 |
| Подготовка к аудиторным занятиям | 4 | 48 |
| Выполнение курсовой работы (курсового проекта) | | - |
| Подготовка и защита рефератов, расчетно-графических работ | 10 | 10 |
| Другие виды самостоятельной работы | | |
| Экзамен/часы | | |
| Формы промежуточной аттестации (зачёт, экзамен) | Зачет | Зачет |

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план).

Темы разделов и виды занятий.

| № п/ п | Разделы дисциплины | Количество часов | | |
|------------------------|---|------------------|--------|----|
| | | Л | ПрактЗ | СР |
| очная форма обучения | | | | |
| 1 | Тема 1. Риск как экономическая категория и его место в хозяйственно-финансовой деятельности | 2 | 3 | 1 |
| 2 | Тема 2. Основы организации финансового риск-менеджмента | 2 | 3 | 1 |
| 3 | Тема 3. Методы количественной оценки финансовых и кредитных рисков | 2 | 3 | 1 |
| 4 | Тема 4. Оценка финансовых и кредитных рисков, методы их снижения и критерии их выбора | 2 | 3 | 1 |
| 5 | Тема 5. Особенности управления инвестиционными рисками | 2 | 4 | 2 |
| 6 | Тема 6. Управление рисками невыполнения обязательств по ссудам | 2 | 4 | 2 |
| 7 | Тема 7. Особенности управления процентным риском | 2 | 4 | 2 |
| 8 | Тема 8. Особенности управления риском ликвидности | 2 | 4 | 1 |
| 9 | Тема 9. Особенности управления валютными рисками | 2 | 4 | 1 |
| 10 | Тема 10. Система мониторинга отраслевого риска | 1 | 3 | 1 |
| 11 | Тема 11. Учет странового риска в хозяйственно-финансовой деятельности | 1 | 3 | 1 |
| | Итого | 20 | 38 | 14 |
| Заочная форма обучения | | | | |
| 1 | Тема 1. Риск как экономическая категория и его место в хозяйственно-финансовой деятельности | 2 | - | 4 |
| 2 | Тема 2. Основы организации финансового риск-менеджмента | 2 | - | 4 |
| 3 | Тема 3. Методы количественной оценки финансовых и кредитных рисков | 2 | - | 5 |
| 4 | Тема 4. Оценка финансовых и кредитных рисков, методы их снижения и критерии их выбора | 2 | - | 5 |
| 5 | Тема 5. Особенности управления инвестиционными рисками | - | 1 | 5 |
| 6 | Тема 6. Управление рисками невыполнения обязательств по ссудам | - | 1 | 5 |
| 7 | Тема 7. Особенности управления процентным риском | - | 1 | 6 |
| 8 | Тема 8. Особенности управления риском ликвидности | - | 1 | 6 |
| 9 | Тема 9. Особенности управления валютными рисками | - | 1 | 6 |
| 10 | Тема 10. Система мониторинга отраслевого риска | - | 1 | 6 |
| 11 | Тема 11. Учет странового риска в хозяйственно-финансовой деятельности | - | - | 6 |
| | Итого | 8 | 6 | 58 |

4.2. Содержание разделов учебной дисциплины.

Тема 1. Риск как экономическая категория и его место в хозяйственно-финансовой деятельности

Основные подходы к определению понятия “риск”. Проявление природы риска: противоречивость; неопределенность; отсутствие полной информации; случайность; альтернативность; противодействие.

Признаки классификации рисков: причины возникновения; формы проявления; степень воздействия; время воздействия; возможность управления; метод расчета; сфера возникновения.

Сущность и содержание финансово-кредитных рисков. Краткий обзор теорий предпринимательского риска: классической, неоклассической, кейнсианской. Влияние рисков на результаты хозяйственно-финансовой деятельности: кривая риска; зоны риска; коэффициент риска; шкалы риска.

Тема 2. Основы организации финансового риск-менеджмента

Понятие “риск-менеджмента” как составной части финансового менеджмента. Стратегия и тактика управления риском. Объекты и субъекты управления риском. Основные принципы (правила) риск-менеджмента.

Основные этапы управления риском: анализ риска включает сбор и обработку данных по аспектам риска, качественный и количественный анализ риска; меры по устранению и минимизации риска включают выбор и обоснование предельно допустимых уровней риска, выбор методов снижения риска, формирование вариантов рискового вложения капитала и оценку их оптимальности.

Сущность стратегии и тактики принятия управленческих решений в условиях риска. Основные правила принятия управленческих решений. Способы выбора управленческих решений. Типы стратегий в условиях неопределенности: ожидание будущего; адаптация к будущему; закрепление права на игру. Варианты действий в условиях неопределенности: большие ставки; опционы; беспроигрышные действия.

Группировка людей по их отношению к риску. Особенности принятия управленческих решений в условиях риска различными группами менеджеров.

Тема 3. Методы количественной оценки финансовых и кредитных рисков

Сущность статистического метода оценки подверженности рискам. Случайные величины. Вероятность и частота наступления событий. Степень колеблемости (изменчивости) возможного результата наступления события. Показатели: среднее математическое ожидание случайной величины, дисперсия, стандартное отклонение, коэффициент вариации.

Сущность метода экспертных оценок степени риска. Характеристика экспертных процедур, индивидуальных и групповых экспертных оценок. Общая схема проведения экспертных оценок: подбор экспертов и формирование экспертных групп; формирование вопросов и составление анкет; работа с экспертами; анализ и обработка экспертных оценок.

Сущность аналитического метода оценки рисков. Применение элементов теории игр. Оценка совокупного риска.

Тема 4. Оценка финансовых и кредитных рисков, методы их снижения и критерии их выбора

Характеристика основных методов снижения риска: страхование; резервирование средств; лимитирование; диверсификация. Выбор метода снижения риска на основе сопоставления уровня потерь и вероятности их наступления.

Тема 5. Особенности управления инвестиционными рисками

Инвестиционные риски как основная составляющая финансовых рисков. Виды инвестиционных рисков: риски прямых инвестиций и портфельные риски; риски упущенной выгоды, риски снижения доходности, риски прямых финансовых потерь. Особенности оценки степени инвестиционных рисков, коэффициент чувствительности бета.

Тема 6. Управление рисками невыполнения обязательств по ссудам

Особенности управления кредитными рисками. Классификация кредитов по качеству ссудной задолженности. Создание резервов на покрытие возможных потерь по ссудам банка. Основные методы взыскания просроченных долгов по ссудам. Факторы, влияющие на выбор метода взыскания задолженности по просроченным кредитам.

Тема 7. Особенности управления процентным риском

Определение и содержание процентного риска. Стратегии управления процентным риском: управление процентной маржей, стратегии управления “гэпом”. Фьючерсные процентные ставки и хеджирование. Процентные свопы.

Тема 8. Особенности управления риском ликвидности

Сущность и содержание риска ликвидности. Взаимосвязь риска ликвидности с другими видами финансовых рисков. Особенности оценки степени риска ликвидности: оценка коэффициентов ликвидности и движения денежных потоков. Стратегии управления риском ликвидности: стратегия управления активами; стратегия управления пассивами.

Тема 9. Особенности управления валютными рисками

Понятие и сущность валютных рисков. Виды валютных рисков: экономический риск, риск перевода, риск сделки. Операции “спот”, “своп”, “форвард”, хеджирование валютного риска.

Тема 10. Система мониторинга отраслевого риска

Сущность и содержание отраслевого риска. Мониторинг жизненного цикла отрасли и внутриотраслевой конкурентной среды. Оценка систематического риска на основе коэффициента чувствительности бета.

Тема 11. Учет странового риска в хозяйственно-финансовой деятельности

Определение странового риска. Анализ странового риска. Рейтинги политического и экономического рисков. Категории стран по качеству обслуживания внешнего долга. Проблемы рейтинговой оценки странового риска.

4.3. Перечень тем лекций.

Перечень тем лекций

| № п/п | Разделы дисциплины | очная форма обучения | Заочная форма обучения |
|-------|---|----------------------|------------------------|
| | | Количество часов | |
| 1 | Тема 1. Риск как экономическая категория и его место в хозяйственно-финансовой деятельности | 2 | 2 |
| 2 | Тема 2. Основы организации финансового риск-менеджмента | 2 | 2 |
| 3 | Тема 3. Методы количественной оценки финансовых и кредитных рисков | 2 | 2 |
| 4 | Тема 4. Оценка финансовых и кредитных рисков, методы их снижения и критерии их выбора | 2 | 2 |
| 5 | Тема 5. Особенности управления инвестиционными рисками | 2 | - |
| 6 | Тема 6. Управление рисками невыполнения обязательств по ссудам | 2 | - |
| 7 | Тема 7. Особенности управления процентным риском | 2 | - |
| 8 | Тема 8. Особенности управления риском ликвидности | 2 | - |
| 9 | Тема 9. Особенности управления валютными рисками | 2 | - |
| 10 | Тема 10. Система мониторинга отраслевого риска | 1 | - |
| 11 | Тема 11. Учет странового риска в хозяйственно-финансовой деятельности | 1 | - |
| | Итого | 20 | 8 |

4.4. Перечень тем лабораторных занятий.

«Не предусмотрен».

4.5. Перечень тем практических занятий (семинаров).

Перечень тем практических занятий

| № п/п | Разделы дисциплины | очная форма обучения | Заочная форма обучения |
|-------|---|----------------------|------------------------|
| | | Количество часов | |
| 1 | Тема 1. Риск как экономическая категория и его место в хозяйственно-финансовой деятельности | 3 | - |
| 2 | Тема 2. Основы организации финансового риск-менеджмента | 3 | - |
| 3 | Тема 3. Методы количественной оценки финансовых и кредитных рисков | 3 | - |
| 4 | Тема 4. Оценка финансовых и кредитных рисков, методы их снижения и критерии их выбора | 3 | - |
| 5 | Тема 5. Особенности управления инвестиционными рисками | 4 | 1 |
| 6 | Тема 6. Управление рисками невыполнения обязательств по ссудам | 4 | 1 |
| 7 | Тема 7. Особенности управления процентным риском | 4 | 1 |
| 8 | Тема 8. Особенности управления риском ликвидности | 4 | 1 |
| 9 | Тема 9. Особенности управления валютными рисками | 4 | 1 |
| 10 | Тема 10. Система мониторинга отраслевого риска | 3 | 1 |
| 11 | Тема 11. Учет странового риска в хозяйственно-финансовой деятельности | 3 | - |
| | Итого | 38 | 6 |

4.6. Виды самостоятельной работы студентов и перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся.

4.6.1. Подготовка к аудиторным занятиям.

Перечень методических рекомендаций студентам по закреплению и углублению полученных на аудиторных занятиях знаний и навыков, подготовке к предстоящим занятиям:

1. Сравнительный анализ сведений по изучаемой теме, полученных из различных источников.
2. Устный пересказ изученного материала.
3. Выполнение домашнего задания, предложенного в рабочей тетради.
4. Взаимоконтроль и взаимопроверка знаний студентов.
5. Применение полученных знаний при анализе практических ситуаций.
6. Репетиционное выступление перед студентами.
7. Подбор материалов периодической печати по изучаемой теме.

Для подготовки к конкретным темам занятий студентам могут быть даны иные рекомендации.

4.6.2. Перечень тем курсовых работ

«Не предусмотрены».

4.6.3. Перечень тем рефератов:

| № п/п | Тема реферата, расчётно-графических работ |
|-------|---|
| 1 | Эволюция подходов к понятию «риск» |
| 2 | Обзор теорий предпринимательского риска |
| 3 | Влияние рисков на результаты финансовой деятельности |
| 4 | Финансовый риск-менеджмент, как составная часть финансового менеджмента |
| 5 | Стратегия и тактика принятия управленческих решений в условиях риска |

| | |
|----|---|
| 6 | Особенности принятия управленческих решений в условиях риска различными группами менеджеров |
| 7 | Современные экспертные оценки в риск-менеджменте |
| 8 | Аналитический метод оценки рисков |
| 9 | Теория игр при оценке совокупного риска |
| 10 | Страхование средств как метод снижения финансовых рисков |
| 11 | Систематические риски в финансовом инвестировании: оценка и анализ |
| 12 | Несистематические риски в финансовом инвестировании: оценка и анализ |
| 13 | Резервирование средств, как метод снижения финансовых рисков |
| 14 | Современные методы снижения кредитного риска |
| 15 | Управление рисками реального инвестирования |
| 16 | Хеджирование, как метод управления процентным риском |
| 17 | Управление процентной маржой коммерческого банка |
| 18 | Стратегии управления «гэпом» |
| 19 | Особенности оценки риска ликвидности |
| 20 | Стратегии управления активами коммерческого банка |
| 21 | Стратегии управления пассивами коммерческого банка |
| 22 | Хеджирование валютного риска |
| 23 | Коэффициент чувствительности «бета» и его применение |
| 24 | «Форвард» операции при управлении валютными рисками |
| 25 | Отраслевой риск: методы его оценки и контроля |

4.6.4. Перечень тем и учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся.

| № п/п | Тема самостоятельной работы | Учебно-методическое обеспечение | Объём, ч | |
|-------|---|--|----------------|---------|
| | | | форма обучения | |
| | | | очная | заочная |
| 1. | Риск как экономическая категория и его место в хозяйственно-финансовой деятельности | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.6-37; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 1 | 4 |
| 2. | Основы организации финансового риск-менеджмента | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.38-63; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 1 | 4 |
| 3. | Методы количественной оценки финансовых и кредитных рисков | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.65-82; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 1 | 5 |

| | | | | |
|-----|---|--|---|---|
| 4. | Оценка финансовых и кредитных рисков, методы их снижения и критерии их выбора | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.83-93; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 1 | 5 |
| 5. | Особенности управления инвестиционными рисками | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.94-117; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 2 | 5 |
| 6. | Управление рисками невыполнения обязательств по ссудам | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.117-140; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 2 | 5 |
| 7. | Особенности управления процентным риском | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.140-150; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 2 | 6 |
| 8. | Особенности управления риском ликвидности | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.150-164; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 1 | 6 |
| 9. | Особенности управления валютными рисками | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.164-184; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 1 | 6 |
| 10. | Система мониторинга отраслевого риска | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.184-194; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 1 | 6 |

| | | | | |
|-----|--|--|----|----|
| 11. | Учет странового риска в хозяйственно-финансовой деятельности | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, Р.И. Ляпин. Финансово-кредитные риски – ВГАУ, 2011. – с.194-204; рекомендуемая литература (п.6.1, 6.2) | 1 | 6 |
| Все | | | 14 | 58 |

4.6.5. Другие виды самостоятельной работы студентов.

Студенты по собственному желанию могут подготовить доклады и сообщения для выступления на практических занятиях в рамках выносимой на занятие темы.

4.7. Перечень тем и видов занятий, проводимых в интерактивной форме

| № п/п | Форма занятия | Тема занятия | Интерактивный метод | Объем, ч |
|-------|----------------------|---|---------------------|----------|
| 1 | лекция | Оценка финансовых и кредитных рисков, методы их снижения и критерии их выбора | Мастер класс | 2 |
| 2 | лекция | Особенности управления инвестиционными рисками | Case-study | 2 |
| 3 | практическое занятие | Управление рисками невыполнения обязательств по ссудам | Мастер класс | 2 |
| 4 | практическое занятие | Особенности управления валютными рисками | Мастер класс | 2 |
| 5 | практическое занятие | Особенности управления риском ликвидности | Case-study | 2 |

5. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Полное описание фонда оценочных средств для промежуточной аттестации обучающихся с перечнем компетенций, описанием показателей и критериев оценивания компетенций, шкал оценивания, типовые контрольные задания и методические материалы представлены в отдельном документе ФОС.

6. Учебно-методическое обеспечение дисциплины

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература.

| № п/п | Автор | Заглавие | Гриф издания | Издательство | Год издания | Кол-во экз. в библиот. |
|-------|------------------------------|---|--------------|--------------|-------------|------------------------|
| 1 | Шапкин А. С. Шапкин В. А. | Теория риска и моделирование рискованных ситуаций. Режим доступа: http://znanium.com/go.php?id=450763 | ГРИФ Минобр | «Дашков и К» | 2014 | Электронный ресурс |

| | | | | | | |
|---|-------------------------------|--|----------|------------|------|--------------------|
| 2 | Казакова Н. А. | Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски. Режим доступа: http://znanium.com/go.php?id=780645 | ГРИФ УМО | «ИНФРА-М» | 2017 | Электронный ресурс |
| 3 | Новиков А.И. Солодкая Т.И. | Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах [Электронный ресурс] Режим доступа: http://znanium.com/go.php?id=415289 | | Дашков и К | 2013 | Электронный ресурс |

6.1.2. Дополнительная литература.

| № п/п | Автор | Заглавие | Издательство | Год издания |
|-------|---|---|----------------------------|-------------|
| 1 | Рыхтикова, Н.А. | Анализ и управление рисками организации | Форум | 2009 |
| 2 | Уродовских В. Н. | Управление рисками предприятия [Электронный ресурс] Режим доступа: http://znanium.com/go.php?id=615086 | Вузовский учебник: ИНФРА-М | 2017 |
| 3 | Ковалев П. П. | Банковский риск-менеджмент [Электронный ресурс] Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/69167 | Финансы и статистика | 2014 |
| 4 | Воробьев С. Н. Балдин К. В. | Управление рисками в предпринимательстве [Электронный ресурс] Режим доступа: http://znanium.com/go.php?id=430664 | Дашков и К | 2013 |
| 5 | Авдийский В. И. Безденежных В. М. | Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методологии анализа, прогнозирования и управления [Электронный ресурс] Режим доступа: http://znanium.com/go.php?id=394136 | Альфа-М:НИЦ ИНФРА-М | 2013 |
| 6 | Рудько-Селиванов В.В., Кучина Н. В. Зубрилова Н.В. Лапина К.В. Ткаченко В.В. | Управление банковскими рисками в условиях глобализации мировой экономики: Науч.-практ. пос. для спец. / Под ред.В.В. Ткаченко [Электронный ресурс] Режим доступа: http://znanium.com/go.php?id=369947 | ИЦ РИОР: НИЦ Инфра-М | 2013 |
| 7 | А.В. Агибалов, В.В. Пшеничников, И.В. Седлов, | Финансово-кредитные риски | ВГАУ | 2011 |

| | | | | |
|----|---|---|------------------------------------|------|
| | Р.И. Ляпин | | | |
| 8 | Макарова С.Н., Ферова И.С., Янкина И.А. | Управление финансовыми рисками [Электронный ресурс] Режим доступа: http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=549466 | Красноярск: Сиб. федер. ун-т | 2014 |
| 9 | Домашенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. | Управление рисками в условиях финансовой нестабильности [Электронный ресурс] Режим доступа: http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=502885 | М.: Магистр, ИНФРА-М | 2015 |
| 10 | Запорожцева Л.А. | Монография : Стратегическая экономическая безопасность предприятия: методология обеспечения | ВГАУ | 2014 |

6.1.3. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.

| № п/п | Автор | Заглавие | Издательство | Год издания |
|-------|-------|----------|--------------|-------------|
| | | | | |

6.1.4. Периодическая литература.

журнал Финансы и кредит
журнал Справочник экономиста

6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее – сеть «Интернет»), необходимых для освоения дисциплины.

1. Российская газета <http://www.rg.ru/>
2. Экономика и жизнь <http://www.ideg.ru/>
3. Финансовая газета <http://www.fingazeta.ru/>
4. Финансовые известия <http://www.finiz.ru/>
5. Официальный сайт Правительства Российской Федерации <http://www.gov.ru>
6. Официальный сайт Президента Российской Федерации <http://www.kremlin.ru>
7. Стабфонд Российской Федерации <http://www1.minfin.ru/ru/stabfund>
8. Внешний долг Российской Федерации http://www1.minfin.ru/ru/public_debt/internal
9. Внутренний долг Российской Федерации
http://www1.minfin.ru/ru/public_debt/internal
10. Бюджет <http://www1.minfin.ru/ru/budget>
11. Реформы МинФина: <http://www1.minfin.ru/ru/reforms>
12. Professional Risk Managers' International Association <http://www.prmia.org>
13. Global Association of Risk Professionals <http://www.garp.com>
14. International Organization of Securities Commissions <http://www.iosco.org>
15. Basle Committee on Banking Supervision <http://www.bis.org>
16. Гильдия Инвестиционных и Финансовых Аналитиков <http://www.gifa.ru>
17. Национальная Фондовая Ассоциация <http://www.nfa.ru>
18. Федеральная Комиссия по рынку Ценных Бумаг <http://www.fedcom.ru>

19. РЭА Риск-менеджмент rmm.rea.ru
20. Институт управления рисками <http://www.risks.ru>
21. Центр Статистических Исследований <http://www.riskcontrol.ru>
22. <http://www.finrisk.ru>
23. Сайт независимого рейтингового агентства "Рус-Рейтинг" <http://www.rusrating.ru>
24. Финансовый словарь <http://www.xfin.ru>
25. Счетная палата Российской Федерации <http://www.ach.gov.ru>
26. Экспертно-консультативный Совет при Председателе счетной палаты РФ <http://www.eks.ru>
27. Администрация Воронежской области <http://www.govvrn.ru/wps/wcm/connect/Voronezh/AVO/Main>
28. Главное финансовое управление Воронежской области <http://www.gfu.vrn.ru/>
29. Воронежская областная Дума <http://www.vrnoblduma.ru/>

Электронные полнотекстовые ресурсы Научной библиотеки ВГАУ
[\(http://library.vsau.ru/\)](http://library.vsau.ru/)

| Наименование ресурса | Сведения о правообладателе | Адрес в сети Интернет |
|--|---|---|
| ЭБС «Znanium.com» | ООО «Научно-издательский центр ИНФРА-М» | http://znanium.com |
| ЭБС издательства «Лань» | ООО «Издательство Лань» | http://e.lanbook.com |
| ЭБС издательства «Перспектива науки» | ООО «Перспектива науки» | www.prospektnauki.ru |
| ЭБС «Национальный цифровой ресурс «РУКОНТ» | ООО «ТРАНСЛОГ» | http://rucont.ru/ |
| Электронные информационные ресурсы ФГБНУ ЦНСХБ (терминал удаленного доступа) | Федеральное гос. бюджетное учреждение «Центральная научная сельскохозяйственная библиотека» | http://www.cnsnb.ru/terminal/ |
| Научная электронная библиотека ELIBRARY.RU | ООО «РУНЭБ» | www.elibrary.ru |
| Электронный архив журналов зарубежных издательств | НП «Национальный Электронно-Информационный Консорциум» | http://archive.neicon.ru/ |
| Национальная электронная библиотека | Российская государственная библиотека | https://нэб.рф/ |

6.3. Средства обеспечения освоения дисциплины.

6.3.1. Компьютерные обучающие и контролирующие программы.

| № п/п | Вид учебного занятия | Наименование программного обеспечения | Функция программного обеспечения | | |
|-------|----------------------|--|----------------------------------|--------------|-----------|
| | | | контроль | моделирующая | обучающая |
| 1 | лекция | Microsoft Office 2003 Pro Microsoft Office 2010 Std | - | + | + |

| | | | | | |
|---|----------------------|--|---|---|---|
| 2 | практическое занятие | Microsoft Office 2003 Pro Microsoft Office 2010 Std AST, Гарант, Консультант+ (СС Деловые бумаги), ИНЭК Аналитик, Statistica | + | + | + |
|---|----------------------|--|---|---|---|

6.3.2. Аудио- и видеопособия.

| № п/п | Вид пособия | Наименование |
|-------|------------------|--------------|
| | Не предусмотрены | |

6.3.3. Компьютерные презентации учебных курсов.

Темы лекций, по которым имеется презентация

Тема 1. Риск как экономическая категория и его место в хозяйственно-финансовой деятельности

Тема 2. Основы организации управления финансово-кредитными рисками

Тема 3. Методы количественной оценки финансовых и кредитных рисков

Тема 4. Основные методы снижения финансово-кредитных рисков и критерии их выбора

Тема 5. Особенности оценки и минимизации инвестиционных рисков

Тема 6. Защита от потерь при невыполнении обязательств по ссудам

Тема 7. Особенности управления процентным риском

Тема 8. Особенности управления риском ликвидности

Тема 9. Особенности управления валютными рисками

Тема 10. Система мониторинга отраслевого риска

Тема 11. Учет странового риска в хозяйственно-финансовой деятельности

7. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине



| № п/п | Наименование оборудованных учебных кабинетов, объектов для проведения занятий | Перечень основного оборудования, приборов и материалов |
|-------|---|---|
| 1 | Лекционные аудитории | - видеопроекторное оборудование для презентаций; - средства звуковоспроизведения; - экран; - выход в локальную сеть и Интернет. |
| 2 | Аудитории для проведения лабораторных и практических занятий | 15 компьютеров в каждой аудитории с выходом в локальную сеть и Интернет, доступ к справочно-правовым системам «Гарант» и «Консультант Плюс», электронные учебно-методические материалы. |
| 3 | Лаборатория «Учебный банк» - ауд. 374 | -кассовый узел; - рабочие места операционистов; - мультимедиа установкой; - электронное табло валют; - компьютеры; - информационные стенды; - набор рекламных проспектов по банковским продуктам; - принтер. |
| 4 | Аудитории для текущего контроля и промежуточной | 15 компьютеров в каждой аудитории с программой промежуточного и текущего тестирования AST-Test Player 3.1.3) |

| | | |
|---|--|--|
| | аттестации (ауд. 115, 116, 119, 120, 122, 122а, 126) | |
| 5 | Аудитории для групповых и индивидуальных консультаций (ауд. 374, 347, 349) | 9 компьютеров, 3 принтера, сканер; |
| 6 | Помещение для самостоятельной работы и выполнения курсовых проектов/работ (читальный зал ауд. 232а, читальный зал научной библиотеки, компьютерный класс общежития №7) | 50 компьютеров с выходом в локальную сеть и Интернет, доступом к справочно-правовым системам «Гарант» и «Консультант Плюс», электронные учебно-методические материалы, библиотечному электронному каталогу, ЭБС, к электронной информационно-образовательной среде |
| 7 | Помещение для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования (лаборантская ауд. 348, отдел оперативного обеспечения учебного процесса ауд. 115а) | - 2 компьютера, сканер, два принтера; - специализированное оборудование для ремонта компьютеров и оргтехники |

8 Междисциплинарные связи

Протокол

согласования рабочей программы с другими дисциплинами специальности

| Наименование дисциплины, с которой проводилось согласование | Кафедра | Предложения об изменениях в рабочей программе. Заключение об итогах согласования | Подпись зав. кафедрой |
|---|------------------|--|---|
| Финансовый менеджмент | Финансы и кредит | <i>согласовано</i> |  |
| Корпоративные финансы | Финансы и кредит | <i>согласовано</i> |  |

