

Министерство науки и высшего образования
Российской Федерации

Федеральное государственное бюджетное
образовательное учреждение высшего образования
«Донецкий государственный университет»

Экономический факультет
Кафедра международного бизнеса и делового администрирования



П.А. Машаров

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
«АНАЛИЗ ФИНАНСОВЫХ РИСКОВ»


Укрупненная группа направлений подготовки	38.00.00 Экономика и управление
Программа высшего образования	Программа бакалавриата
Направление подготовки	38.03.01 Экономика
Профиль подготовки	Международное налогообложение и бизнес-разведка
Квалификация	Бакалавр
Форма обучения	Очная, очно-заочная

Рабочая программа адаптирована для лиц
с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Донецк 2024

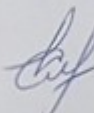
Рабочая программа дисциплины «Анализ финансовых рисков» для обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (Профиль: Международное налогообложение и бизнес-разведка), составлена на основании Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования – бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 12 августа 2020 г. № 954 (с изм. и доп.), Порядка организации и осуществления образовательной деятельности по образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры, утвержденного приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации от 06 апреля 2021 г. № 245 (с изм. и доп.), в соответствии с учебным планом, утвержденным Ученым советом ФГБОУ ВО «ДонГУ» для набора 2024 года.

Разработчик:
доцент кафедры международного бизнеса
и делового администрирования
канд. экон. наук, доцент

 Е. Ю. Забавина

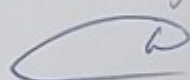
Рабочая программа одобрена на заседании кафедры международного бизнеса
и делового администрирования
Протокол от 26.03.2024 г. № 9

Заведующий кафедрой

 О. Л. Некрасова

СОГЛАСОВАНО:


Декан экономического факультета
28.03.2024 г.

 Ю. Н. Полшков

Учебно-методическая комиссия экономического факультета
Протокол от 27.03.2024 г. № 7
Председатель

 Е. Н. Стрелина

Руководитель основной профессиональной
образовательной программы,
д-р экон. наук, доцент
26.03.2024 г.

 О. Л. Некрасова

1. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

1.1. Требования к предварительной подготовке обучающихся, предшествующие и сопутствующие дисциплины, на которых основывается изучение данной:

дисциплины программы бакалавриата: «Финансы», «Оценка конкурентоспособности в бизнесе», «Финансовая разведка».

Дисциплины, курсовые работы и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее:

«Международный финансовый рынок», производственная практика: преддипломная практика; выпускная квалификационная работа.

2. ОПИСАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

2.1. Общая характеристика

Наименование показателя	Значение показателя
Название образовательной программы	38.03.01 Экономика (Профиль: Международное налогообложение и бизнес-разведка)
Шифр и название в соответствии с учебным планом	Б1.В.ОД. 19 «Анализ финансовых рисков»
Часть образовательной программы	Вариативная часть: выбор вуза
Количество зачетных единиц / всего часов	4 / 144

2.2. Распределение часов по формам и периодам обучения

Форма обучения	курс	семестр	Общее количество часов					Форма контроля
			лекционных	лабораторных	практических	самостоятельной работы + контроль	всего	
Очная	4	7	34	-	34	76	144	экзамен
Очно-заочная	5	9	10	-	10	124	144	экзамен

3. ЦЕЛИ ДИСЦИПЛИНЫ

Формирование системы теоретических знаний, прикладных умений и навыков, позволяющих применять методы и инструменты анализа и управления финансовыми рисками в организации.

4. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ КОМПОНЕНТА ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ, ИХ ИНДИКАТОРЫ И ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ

4.1. Компетенции

ПК-3 Способен к формированию, анализу, обоснованию возможных решений на основе разработанных для них целевых показателей с учетом возможных рисков.

Индикаторы компетенций

Компетенции	Индикаторы	Результаты обучения
ПК-3 Способен к формированию, анализу, обоснованию возможных решений на основе разработанных для них целевых показателей с учетом возможных рисков.	ПК-3.И-1. Демонстрирует способность разработки вариантов риск-ориентированных решений и обоснования их выбора	ПК-3.1.1. Знает классификацию финансовых рисков
		ПК-3.1.2. Знает основные элементы системы управления рисками
		ПК-3.1.3. Знает количественные, качественные и комбинированные методы оценки и анализа финансовых рисков
		ПК-3.1.4. Умеет выявлять, регистрировать, анализировать и классифицировать риски и разрабатывать комплекс мероприятий по их минимизации
		ПК-3.1.5. Умеет обобщать результаты проведенных расчетов, формулировать выводы, представлять результаты аналитической работы

5. ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Темы	Краткое содержание темы
<i>Содержательный модуль 1. Идентификация финансовых рисков</i>	
<i>Тема 1.</i> Понятие и классификация финансовых рисков	1.Понятие финансового риска. Объективная природа финансового риска. 2.Риски в предпринимательской деятельности. Уровень риска. 3.Классификация финансовых рисков.
<i>Тема 2.</i> Финансовый риск-менеджмент	1.Современная теория финансового риск-менеджмента: предпосылки возникновения и основные этапы развития. 2.Задачи и роль управления финансовыми рисками в деятельности компаний. 3.Задачи и принципы составления программы управления рисками
<i>Тема 3.</i> Источники информации, необходимые для оценки финансовых рисков	1. Организация сбора информации и ее источники. 2. Требования к получаемой информации. 3. Раскрытие информации.
<i>Тема 4.</i> Идентификация финансовых рисков.	1. Идентификация рисковых обстоятельств, выявление потенциальных рисков и факторов их развития в финансовой деятельности фирмы. 2. Количественные методы оценки и анализа финансовых рисков. 3. Качественные методы оценки и анализа финансовых рисков. 4. Комбинированные методы оценки и анализа финансовых рисков.

Содержательный модуль 2. Управление финансовыми рисками	
Тема 5. Кредитные риски хозяйствующих субъектов: понятие, виды и способы управления	1. Понятие кредитного риска. Отношения кредитора и должника по различным сделкам. Роль кредитного риска в предпринимательской деятельности. 2. Позиционный и портфельный кредитный риск. 3. Кредитные риски по валютным, фондовым и товарным операциям. 4. Основные подходы к управлению кредитными рисками.
Тема 6. Риски дефицита ликвидности	1. Понятие ликвидности. Ликвидность актива, ликвидность организации, ликвидность рынка. 2. Внешние (макроэкономические) и внутренние (микроэкономические) факторы ликвидности. 3. Показатели и нормативы ликвидности. Ликвидность и платежеспособность организации. 4. Риск утраты ликвидности. Количественный и ценовой риск ликвидности.
Тема 7. Понятие и виды рыночных рисков хозяйствующих субъектов	1. Виды рыночных рисков и их связь со степенью развития и конъюнктурой соответствующих финансовых и товарных рынков. 2. Ценовые риски хозяйствующих субъектов, методы их оценки и регулирования. 3. Валютный риск организации. 4. Фондовый риск организации. 5. Процентный риск организации. Инвестиционные риски хозяйствующих субъектов.
Тема 8. Механизмы нейтрализации финансовых рисков	1. Понятие и формирование системы внутренних механизмов нейтрализации финансовых рисков. 2. Разработка мероприятий по исключению конкретных видов финансового риска. 3. Страхование и самострахование финансовых рисков.

6. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1. Форма обучения – очная, курс – 4, семестр – 7

Наименования содержательных модулей и тем	Количество часов				
	Лекц.	Лабор.	Практ.	СРС+К	Всего
Содержательный модуль 1. Идентификация финансовых рисков					
Тема 1. Понятие и классификация финансовых рисков	4	0	4	10	18
Тема 2. Финансовый риск-менеджмент	4	0	4	10	18
Тема 3. Источники информации, необходимые для оценки финансовых рисков	4	0	4	10	18
Тема 4. Идентификация финансовых рисков	4	0	4	10	18
Итого по содержательному модулю 1	16	0	16	40	72
Содержательный модуль 2. Управление финансовыми рисками					

Тема 5. Кредитные риски хозяйствующих субъектов: понятие, виды и способы управления	5	0	5	8	18
Тема 6. Риски дефицита ликвидности	5	0	5	8	18
Тема 7. Понятие и виды рыночных рисков хозяйствующих субъектов	4	0	4	10	18
Тема 8. Механизмы нейтрализации финансовых рисков	4	0	4	10	18
Итого по содержательному модулю 2	18	0	18	36	72
Всего по компоненту ОПОП	34	0	34	76	144

6.2. Форма обучения – очно-заочная, курс – 5, семестр – 9

Наименования разделов и тем	Количество часов				
	Лекц.	Лабор.	Практ.	СРС+К	Всего
Содержательный модуль 1. Идентификация финансовых рисков					
Тема 1. Понятие и классификация финансовых рисков	1	0	1	16	18
Тема 2. Финансовый риск-менеджмент	1	0	1	16	18
Тема 3. Источники информации, необходимые для оценки финансовых рисков	1	0	1	16	18
Тема 4. Идентификация финансовых рисков	1	0	1	16	18
Итого по содержательному модулю 1	4	0	4	64	72
Содержательный модуль 2. Управление финансовыми рисками					
Тема 5. Кредитные риски хозяйствующих субъектов: понятие, виды и способы управления	2	0	2	14	18
Тема 6. Риски дефицита ликвидности	2	0	2	14	18
Тема 7. Понятие и виды рыночных рисков хозяйствующих субъектов	1	0	1	16	18
Тема 8. Механизмы нейтрализации финансовых рисков	1	0	1	16	18
Итого по содержательному модулю 2	6	0	6	60	72
Всего по компоненту ОПОП	10	0	10	124	144

7. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ (СРЕДСТВА) ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

7.1. Контрольные вопросы

Содержательный модуль 1 Идентификация финансовых рисков

- 1) Понятие риска и его особенности как экономической категории.
- 2) Взаимосвязь категорий риск и доходность.
- 3) Взаимосвязь понятий «риск» и «убытки».
- 4) Классификация финансовых рисков хозяйствующих субъектов.
- 5) Сущность идентификации рисков хозяйствующих субъектов.
- 6) Функции финансового риск-менеджмента.
- 7) Основные методы анализа финансовых рисков хозяйствующих субъектов.
- 8) Основные подходы к оценке риска хозяйствующих субъектов.
- 9) Финансовые риски в предпринимательской деятельности.
- 10) Характеристика, анализ и оценка финансовых рисков.
- 11) Методы управления рисками.
- 12) Количественные и качественные методы анализа финансовых рисков.
- 13) Комбинированные методы оценки и анализа финансовых рисков.
- 14) Организация сбора информации и ее источники.

Содержательный модуль 2 Управление финансовыми рисками

- 15) Понятие ликвидности. Ликвидность актива, ликвидность организации, ликвидность рынка.
- 16). Внешние (макроэкономические) и внутренние (микроэкономические) факторы ликвидности.
- 17) Показатели и нормативы ликвидности.
- 18) Ликвидность и платежеспособность организации.
- 19) Риск утраты ликвидности.
- 20) Количественный и ценовой риск ликвидности.
- 21) Виды рыночных рисков и их связь со степенью развития и конъюнктурой соответствующих финансовых и товарных рынков.
- 22) Ценовые риски хозяйствующих субъектов, методы их оценки и регулирования.
- 23) Валютный риск организации.
- 24) Фондовый риск организации.
- 25) Процентный риск организации.
- 26) Инвестиционные риски хозяйствующих субъектов.
- 27) Понятие и формирование системы внутренних механизмов нейтрализации финансовых рисков.
- 28) Разработка мероприятий по исключению конкретных видов финансового риска.
- 29) Страхование финансовых рисков.
- 30) Самострахование финансовых рисков.

7.2. Темы докладов (рефератов)

Не предусмотрены программой дисциплины

7.3. Темы письменных работ (типы задач)

Модульная контрольная работа проводится в виде тестирования.

Тестирование включает 20 тестовых заданий по темам 1-4.

Время выполнения – 30 минут.

ОБРАЗЕЦ ЗАДАНИЯ МОДУЛЬНОГО КОНТРОЛЯ

Модульная контрольная работа

Вариант № n

1. По источникам возникновения выделяют группы финансово-банковских рисков:
А) рыночный, кредитный, риск ликвидности
Б) рыночный, кредитный, операционный, правовой
В) рыночный, кредитный, операционный, правовой, страновой
Г) рыночный, кредитный, операционный, правовой, страновой, риск ликвидности
Д) рыночный, кредитный, операционный, правовой, страновой, риск ликвидности, риск колебаний цен товаров
2. Продолжите предложение. При росте рыночной процентной ставки, стоимость активов с фиксированной доходностью...:
А) растет
Б) падает
В) остается неизменной
3. Продолжите предложение. При снижении рыночной процентной ставки, стоимость активов с фиксированной доходностью...:
А) растет
Б) падает
В) остается неизменной
4. Виды рыночного риска:
А) процентный
Б) валютный
В) риск колебаний рыночных цен товаров
Г) риск колебаний цен акций и производных финансовых инструментов
Д) суверенный риск
5. Выберите неверное утверждение о сущности кредитного риска:
А) риск изменения кредитного статуса контрагента, заемщика или эмитента финансового инструмента
Б) риск отрицательного воздействия рыночных факторов
Г) риск дефолта (неспособности или нежелания контрагента отвечать по своим обязательствам)
Д) риск изменения кредитоспособности и надежности контрагента, эмитента ценных бумаг и обязательств
6. Выберите верное утверждение:
А) Наиболее надежными с наименьшим кредитным риском считаются государственные обязательства
Б) Наиболее надежными с наименьшей вероятностью отказа от выплаты процентов и дефолта считаются ценные бумаги коммерческих институтов

7. Операционный риск называют также:

- А) управленческим
- Б) риском недостаточности (ошибочности) информации
- В) эмпирическим
- Г) техническим
- Д) контрольным

8. Ослабление и практически полное устранение риска достигают путем следующих методов управления:

- А) отказ от риска
- Б) снижение частоты ущерба или возникновения убытка
- В) уменьшение размера убытков
- Г) разделение риска
- Д) стратегическое (долгосрочное) инвестирование в рискованные финансовые активы

9. Компенсирование риска и управление риском возможно с помощью:

- А) рискованных премий
- Б) исключительно измерительных операций
- В) диверсификации инвестиций
- Г) хеджирования
- Д) «плат за риск»

10. Реализация риск-менеджмента на современных предприятиях включает в себя:

- А) выявление последствий деятельности экономических субъектов в ситуации риска;
- Б) прогнозирование этой деятельности для снижения уровня риска;
- В) умение реагировать на возможные отрицательные последствия этой деятельности;
- Г) умение ликвидировать такие последствия;
- Д) разработка и осуществление мер, при помощи которых могут быть нейтрализованы или компенсированы вероятные негативные результаты предпринимаемых действий.

11. Теоретическое объяснение рискованных ситуаций и их природы дает, например, теория хаоса, которая:

- А) изучает кажущееся случайным поведение детерминированных динамических систем
- Б) является особым разделом математики
- В) дает представление о непредсказуемости хаотической системы
- Г) дает представление о предсказуемости хаотической системы

12. Измерители риска:

- А) показатели вероятности дефолта
- Б) стоимость под риском
- В) налоговая база
- Г) волатильность
- Д) портфельный мониторинг

13. Рейтинг – единственный способ измерения для:

- А) кредитного риска
- Б) фондового и операционного рисков
- В) операционного и странового рисков
- Г) инвестиционного риска и инвестиционного потенциала
- Д) рыночного риска

14. Рейтинги бывают:

- А) внешние
 Б) внешние и внутренние
 В) внутренние
 Г) качественные и экспертные
 Д) объективные и субъективные
15. Зарубежные рейтинговые агентства:
 А) «Стэндард энд Пурс» (Standard and Poor's, S&P)
 Б) «Фитч Рейтинг» (Fitch Rating)
 В) «Муди'з» (Moody's)
 Г) Рейтинговое агентство «Эксперт РА»
 Д) Рейтинговое агентство «Инерфакс»
16. Объектами рейтинга могут быть:
 А) страны, коммерческие банки, центральные банки и другие финансовые институты
 Б) эмитенты различных долговых обязательств
 В) различные финансовые обязательства
 Г) финансовые активы
 Д) все, названное выше
17. Закономерно явление:
 А) чем выше кредитный рейтинг эмитента, тем ниже доходность инструмента (облигации)
 Б) чем ниже кредитный рейтинг эмитента, тем ниже доходность инструмента (облигации)
18. Выберите коды кредитного рейтинга, принятые в Standard and Poor's:
 А) AAA
 Б) AA+
 В) A-
 Г) B1
 Д) Aaa
19. Верно ли утверждение: при прочих равных условиях инструмент с большим сроком более рискован, если все другие факторы риска во внимание не принимаются?
 А) нет, не верно
 Б) затрудняюсь ответить
 В) да, верно
20. К числу «суммирующих» банковских рисков относятся:
 А) Процентный риск
 Б) Кредитный риск
 В) Фондовый риск
 Г) Риск неликвидности
 Д) Риск возникновения убытков и риск уменьшения капитала

КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ ЗАДАНИЯ МОДУЛЬНОГО КОНТРОЛЯ

Вид задания	Количество баллов
1 тестовое задание	1,0
Количество тестов	20
Всего	20

7.4. Образец содержания экзаменационного билета

ФГБОУ ВО «ДОНЕЦКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ
КАФЕДРА МЕЖДУНАРОДНОГО БИЗНЕСА И ДЕЛОВОГО АДМИНИСТРИРОВАНИЯ

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Профиль: «Международное налогообложение и бизнес-разведка»

Образовательная программа: бакалавриат

Семестр: 7 (очная), 9 (очно-заочная)

Учебная дисциплина: «Анализ финансовых рисков»

Экзаменационный билет № п

1. Теоретическое задание.

1.1. Взаимосвязь категорий риск и доходность.

1.2. Виды страхования финансовых рисков.

2. Практическое задание.

2.1. Необходимо выбрать вариант вложения капитала: в мероприятие 1 или 2. При вложении капитала в мероприятие 1 из 200 случаев прибыль 25 тыс. руб. была получена в 20 случаях, прибыль 30 тыс. рублей была получена в 80 случаях, прибыль 40 тыс. руб. была получена в 100 случаях. При вложении капитала в мероприятие 2 из 240 случаев прибыль 30 тыс.руб была получена в 144 случаях, прибыль 35 тыс. руб в 72 случаях. Критерием выбора является наибольшая сумма средней прибыли.

2.2. Немецкая компания поставяет автомобили в Швейцарию. Валюта цены контракта – евро (EUR), оплата предполагается через 3 месяца после поставки. Стоимость контракта составляет 1,5 млн. EUR. Курс на дату подписания контракта установлен на уровне 1 EUR = 1 швейцарский франк (CHF). Подвергается ли швейцарский импортер валютному риску? Каковы для него будут финансовые результаты от этой операции в следующих случаях: если курс изменится в сторону усиления швейцарского франка (до 1,2 евро за швейцарский франк); если евро окрепнет до уровня 0,8 евро за швейцарский франк.

Утверждено на заседании кафедры «Международный бизнес
и деловое администрирование»

Протокол № ____ от _____.20____.

Зав. кафедрой
Экзаменатор

д.э.н., доц. Некрасова О.Л.
к.э.н., доц. Забавина Е.Ю.

КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ ЭКЗАМЕНАЦИОННОГО ЗАДАНИЯ

Номер задания	Количество баллов
Теоретическое задание	20
1 задача	10
2 задача	10
Всего	40

8. РАСПРЕДЕЛЕНИЕ БАЛЛОВ, КОТОРЫЕ ПОЛУЧАЮТ ОБУЧАЮЩИЕСЯ

Общая оценка знаний обучающихся по дисциплине проводится по 100-балльной шкале исходя из максимума, приведенного в таблице ниже. Организационно-учебная работа в аудитории оценивается на основе таких критериев как посещаемость занятий, своевременное и качественное выполнение домашних заданий, активность во время проведения лекционных и практических занятий (участие в обсуждении текущего и пройденного материала, решение задач и т.п.).

Содержательные модули	Виды работ	Баллы
Содержательный модуль 1	Организационно-учебная работа студента в аудитории	10
	Самостоятельная работа	10
	Модульная контрольная работа	20
	Итого	40
Содержательный модуль 2	Организационно-учебная работа студента в аудитории	10
	Самостоятельная работа	10
	Итого	20
Экзамен		40
Всего		100

Соответствие баллов оценке

Количество баллов из 100	ECTS	Оценка по пятибалльной шкале	
		Экзамен, дифференцированный зачет	Зачет
90-100	A	отлично	зачтено
80-89	B	хорошо	зачтено
75-79	C		зачтено
70-74	D	удовлетворительно	зачтено
60-69	E		зачтено
35-59	FX	неудовлетворительно	не зачтено
0-34	F		не зачтено

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

В ходе реализации 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, доступного с помощью компьютера со специализированным программным обеспечением;
- для выполнения задания 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;
- письменные задания выполняются на компьютере в письменной форме;
- экзамен проводится в письменной форме на компьютере; возможно проведение 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;
- экзамен и зачёт проводятся в устной форме или выполняются в письменной форме на компьютере.

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.

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.

10. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ УЧЕБНОГО ПРОЦЕССА

Учебные занятия проводятся в 7-м и 5-м корпусах ДонГУ (г. Донецк, ул. Челюскинцев, 186; 1896). Для проведения лабораторных занятий требуется аудитория, оборудованная меловой или маркерной доской, мультимедийный проектор и экран, ноутбук, комплект учебной мебели для студентов, рабочее место преподавателя, выход в Интернет – проводной или с использованием Wi-Fi.

Для самостоятельной работы используются текстовые и электронные ресурсы Научной библиотеки университета и других электронных библиотечных баз данных, учебно-методическое обеспечение, представленное в учебно-методическом кабинете 7-го корпуса (ауд. 103).

Обучающиеся имеют возможность использовать учебные материалы по дисциплине, размещенные на платформе Moodle Центра дистанционного образования экономического факультета «ДонГУ». При изучении дисциплины применяются электронное обучение и дистанционные образовательные технологии.

С использованием ресурсов платформы дистанционного образования осуществляется текущий контроль знаний обучающихся на основе тестирования и проверки результатов самостоятельной работы.

11. РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

11.1. Основная литература

1. Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций [Электронный ресурс] / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 9-е изд. - Электрон. дан. - М.: Дашков и К, 2016. - 544 с.: ил. - Режим доступа: <https://e.lanbook.com/reader/book/93337/>
2. Новиков, А.И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах [Электронный ресурс] : учебное пособие для студентов вузов / А. И. Новиков, Т. И. Солодкая. - Электрон. дан. - М. : Дашков и К°, 2017. - 288 с. - (Учебные издания для бакалавров). - Режим доступа: <https://e.lanbook.com/reader/book/93422>
3. Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие / Н.А. Рыхтикова. - 2-е изд. - М.: Форум, 2014. - 240 с.: 60х90 1/16. - (Высшее образование). (переплет) ISBN 978-5-91134-355-2

11.2. Дополнительная литература

1. Щеголева, Н. Г. Валютный рынок и валютные операции : учебник для вузов / Н. Г. Щеголева. - Москва : Издательство Юрайт, 2023. - 457 с. - (Высшее образование). - ISBN 978-5-534-14687-5. - Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/520231>
2. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски: Учебное пособие / Н.А. Казакова. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 208 с.: 60х90 1/16. - (Высшее образование: Бакалавриат). (переплет) ISBN 978-5-16-004578-8, 500 экз.
3. Саввина, О.В. Управление системными финансовыми рисками в условиях глобализации [Электронный ресурс]: монография / О. В. Саввина. - Электрон. дан. - М.: Дашков и К°, 2015. - 400 с. - (Издательско-торговая корпорация "Дашков и К°"). - Режим доступа: <http://e.lanbook.com/reader/book/72414/>
4. Шапкин А.С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: Учебник для бакалавров / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. - 6-е изд. М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко », 2014. - 880 с. (Электронный ресурс: ЭБС «Книгафонд»)

12. ИНФОРМАЦИОННЫЕ РЕСУРСЫ

1. **Национальная электронная библиотека (НЭБ):** федеральная государственная информационная система / Министерство Культуры РФ; Российская государственная библиотека. – Москва, 2019. – URL: <https://rusneb.ru/> (дата обращения: 01.05.2024). – Режим доступа: свободный, подписка. Необходима установка программного обеспечения. – Текст: электронный.
2. **eLIBRARY.RU:** научная электронная библиотека: сайт. – Москва, 2000. – URL: <https://elibrary.ru> (дата обращения: 01.05.2024). – Режим доступа: для авторизов. пользователей. –Текст: электронный.
3. Научная электронная библиотека **«КиберЛенинка»:** сайт / Ассоциация «Открытая наука». – Москва, 2014. – URL: <https://cyberleninka.ru/>. – Режим доступа: свободный. – Текст: электронный.
4. Электронно-библиотечная система **«Лань»:** [сайт]. – URL: <https://e.lanbook.com> (дата обращения: 01.05.2024). – Режим доступа: для авторизов. пользователей. – Текст: электронный.
5. **ЭБС Юрайт:** электронная библиотечная система: сайт. – Москва, 2013. – URL: <https://biblio-online.ru> (дата обращения: 01.09.2023). – Режим доступа: для авторизов. пользователей. – Текст: электронный.

6. **Электронно-библиотечная система ДонГУ:** сайт / ФГБОУ ВО «ДонГУ». – Донецк, 2016. – URL: <http://library.donnu.ru/> (дата обращения: 01.05.2024). – Режим доступа: свободный. – Текст: электронный.

7. **Электронный каталог** Научной библиотеки ДонГУ: раздел сайта / НБ ДонГУ. – Текст: электронный // ЭБС ДонГУ: сайт. – URL: <http://library.donnu.ru/catalog/> (дата обращения: 01.05.2024). – Режим доступа: поиск свободный, электронные документы – для пользователей ДонГУ.

13. ПРОГРАММНОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

1. Windows 7 PRO (корпоративная лицензия ДонГУ № 46484614)
2. Microsoft Office (корпоративная лицензия ДонГУ № 46472919)
3. Microsoft Visual Studio (лицензия программы Dream Spark для высших учебных заведений)
4. Антивирус Касперского, Adobe Acrobat Reader, xPDF (лицензии GPL, Apache, BSD для свободного программного обеспечения).