МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Тольяттинский государственный университет»

Б1.О.18
(индекс дисциплины)

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН
ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ

Сертификат: 017804780049AF848E43F1EC2D4B4CC120
Владелец: Искосков Максим Олегович
Действителен: с 10.11.2022 до 10.11.2023

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Управление рисками в бизнесе

(наименование дисциплины)

по направлению подготовки (специальности)
38.03.01 Экономика

направленность (профиль)/специализация
Финансовый менеджмент

Форма обучения: заочная

Год набора: 2020

Общая трудоемкость: 5 ЗЕ

Распределение часов дисциплины по курсам

Курс	3	**Итого**
Форма контроля / **Вид занятий**	экзамен	
Лекции	4	4
Лабораторные		
Практические	8	8
Руководство: курсовые работы (проекты) / РГР		
Промежуточная аттестация	0,35	0,35
Контактная работа	12,35	12,35
Самостоятельная работа	159	159
Контроль	8,65	8,65
Итого	180	180

Рабочую программу составил(и):
старший преподаватель департамента бакалавриата (экономических и управленческих программ) Кирюшкина А.Н.

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

Рецензирование рабочей программы дисциплины:

[X] Отсутствует

[ ] Рецензент

(должность, ученое звание, степень, Фамилия И.О.)

Рабочая программа дисциплины составлена на основании ФГОС ВО и учебного плана направление подготовки 38.03.01 «Экономика», направленность (профиль): «Финансовый менеджмент».

Срок действия рабочей программы дисциплины до «31» августа 2025 г.

УТВЕРЖДЕНО

На заседании департамента бакалавриата (экономических и управленческих программ)

(протокол заседания № 1 от « 1 » сентября 2020 г.).

1. Цель освоения дисциплины

Цель освоения дисциплины определяется необходимостью формирования у студентов - специалистов теоретического мышления и практических навыков в области управления рисками в бизнесе

2. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплины и практики, на освоении которых базируется данная дисциплина: Экономика и др.

Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины необходимо как предшествующее: Управление инвестициями, Производственная практика (преддипломная практика) и др.

3. Планируемые результаты обучения

Формируемые и контролируемые компетенции (код и наименование)	**Индикаторы достижения компетенций** (код и наименование)	**Планируемые результаты обучения**
ОПК-4 Способен предлагать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности;	ОПК-4.3. Способность принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности в разрезе управления рисками в бизнесе	Знать: - основные дискуссионные вопросы современной теории рисков; современное законодательство, нормативные и методические документы, касающиеся предпринимательства, как в Российской Федерации, так и за рубежом; содержание основной отечественной и зарубежной монографической литературы по теоретическим вопросам, связанным с управлением рисков, для принятия экономически и финансово обоснованных организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности
		Уметь: - применять полученные знания для количественной и качественной оценки риска; использовать правила и методы управления рисками с целью принятия экономически и финансово обоснованных организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности;
		Владеть: - навыками применения

Формируемые и контролируемые компетенции (код и наименование)	**Индикаторы достижения компетенций** (код и наименование)	**Планируемые результаты обучения**
		полученных знаний для количественной и качественной оценки риска; навыками использования правил и методов управления рисками с целью принятия экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности

4. Структура и содержание дисциплины

Модуль (раздел)	Вид учебной работы	Наименование тем занятий (учебной работы)	Семестр	Объем, ч.	Баллы	Интерактив, ч.	Формы текущего контроля (наименование оценочного средства)
1 Теоретические основы управления рисками в бизнесе	Лек	Теоретический базис управления финансовыми рисками предприятия. Сущность, цели и функции управления финансовыми рисками	6		3	-	Промежуточный тест 1
	Пр						
	Ср			20			
	Лек	Система информационного обеспечения управления финансовыми рисками предприятия	6		10	-	Промежуточный тест 2 Задание 1
	Пр			2			
	Ср			18			
2 Практический инструментарий управления рисками в бизнесе	Лек	Система риск-анализа финансовой деятельности предприятия	6	2	12	-	Промежуточный тест 3 Задание 2
	Пр			2			
	Ср			19			
	Лек	Система риск-планирования финансовой деятельности предприятия	6		11	-	Промежуточный тест 4 Задание 3
	Пр			2			
	Ср			26			
	Лек	Система риск-контроллинга финансовой деятельности предприятия	6		3	-	Промежуточный тест 5
	Пр						
	Ср			20			
3 Механизмы нейтрализации рисков	Лек	Основные механизмы нейтрализации финансовых рисков предприятия и практика их применения	6	2	3	-	Промежуточный тест 6
	Пр			2			
	Ср			21			
	Лек	Механизмы хеджирования финансовых рисков с помощью фьючерсных и форвардных контрактов	6		11	-	Промежуточный тест 7 Задание 4
	Пр						
	Ср			24			
	Лек	Механизмы хеджирования финансовых рисков с помощью опционных и своп контрактов	6		3	-	Промежуточный тест 8
	Пр						
	Ср			21			

Модуль (раздел)	Вид учебной работы	Наименование тем занятий (учебной работы)	Семестр	Объем, ч.	Баллы	Интерактив, ч.	Формы текущего контроля (наименование оценочного средства)
Промежуточная аттестация				0,35			
Контроль				8,65			
Анкета					3		
Итоговое тестирование					40		
			Итого:	**180**	**100**		

5. Образовательные технологии

С целью формирования компетенций у студентов в учебном процессе используется: дистанционные образовательные технологии.

6. Методические указания по освоению дисциплины

Дисциплина подразумевает аудио-/видео- лекции электронного учебника с консультацией преподавателя на форуме, а также выполнение практических заданий с консультацией преподавателя на форуме и через комментарии в заданиях.

Самостоятельная работа способствует формированию аналитического и творческого мышления, совершенствует способы организации учебной деятельности, воспитывает целеустремленность, систематичность и последовательность в работе студентов, развивает у них навык завершать начатую работу.

Виды самостоятельной работы студентов:

1. Самостоятельное изучение материалов электронного учебника с разделением на лекции и с тестами для самоконтроля по каждой лекции, анализ поведения обучающихся при помощи LRS-системы и Experience API, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга

2. Самостоятельное выполнение практических заданий, контроль смены IP-адресов, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга

3. Самостоятельное тестирование по банку тестовых заданий, анализ поведения тестирующихся при помощи LRS-системы и Experience API, контроль смены IP-адресов, удаленная аутентификация при помощи распознавания лиц, анализ текущей успеваемости при помощи БРС-рейтинга

В качестве необходимых материально-технических ресурсов применяется LMS-система на основе Moodle, компьютер, либо планшет, либо смартфон.

7. Оценочные средства

7.1. Паспорт оценочных средств

Семестр	Код контролируемой компетенции (или ее части)	Наименование оценочного средства
6	ОПК-4	Промежуточный тест 1-8 Итоговое тестирование Задание 1 ,2,3,4 Вопросы к экзамену №1-60

7.2. Типовые задания или иные материалы, необходимые для текущего контроля

7.2.1. Примерный перечень заданий промежуточных тестов, итогового тестирования

(наименование оценочного средства)

Задание №1		
Группа рисков, генерирующая различные финансовые угрозы в финансовой деятельности, –		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		группа товарных рисков
2)		группа финансовых рисков
3)		группа валютных рисков
4)		группа предпринимательских рисков

Задание №2		
Проектный риск, при котором эффективность проекта отрицательна, то есть сумма чистого денежного потока меньше суммы инвестиционных затрат, называется		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		катастрофическим
2)		критическим
3)		допустимым
4)		внешним

Задание №3		
Целью количественного анализа проектных рисков выступает		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		выявление рисков
2)		описание рисков
3)		группировка рисков
4)		измерение рисков

Задание №4
Относительным показателем риска инвестиционного проекта является

Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		дисперсия
2)		коэффициент вариации
3)		среднее ожидаемое значение
4)		среднеквадратическое отклонение

Задание №5		
Укажите показатель риска, который характеризует, на сколько в среднем в абсолютном выражении каждый возможный вариант реализации инвестиционного проекта отклоняется от средней величины.		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Среднеквадратическое отклонение
2)		Коэффициент вариации
3)		Дисперсия
4)		Среднее ожидаемое значение

Задание №6		
Какой показатель используют для сравнения рисков проектов с различными значениями среднего ожидаемого дохода?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Среднеквадратическое отклонение
2)		Коэффициент вариации
3)		Индекс рентабельности
4)		Дисперсия

Задание №7		
Средневзвешенное значение всех возможных результатов реализации проекта – это		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		среднеквадратическое отклонение
2)		коэффициент вариации
3)		дисперсия
4)		среднее ожидаемое значение

Задание №8		
В каком диапазоне следует ожидать колебания доходности инвестиционного проекта с вероятностью 68,27 %?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		$A_{средн.} \pm 1{,}29\sigma$
2)		$A_{средн.} \pm \sigma$
3)		$A_{средн.} \pm 3\sigma$
4)		$A_{средн.} \pm 2\sigma$

Задание №9

В каком диапазоне следует ожидать колебания доходности инвестиционного проекта с вероятностью 99,73 %?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Асредн. ± 1,29σ
2)		Асредн. ± σ
3)		Асредн. ± 3σ
4)		Асредн. ± 2σ

Задание №10		
Коэффициент вариации рассчитывается по формуле		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		среднее ожидаемое значение / дисперсия
2)		дисперсия / среднее ожидаемое значение
3)		среднее ожидаемое значение / стандартное отклонение
4)		стандартное отклонение / среднее ожидаемое значение

Задание №11		
Цель _____ – оценить, насколько сильно изменится эффективность проекта при определённом изменении одного из параметров проекта.		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		анализа вероятностей
2)		метода предпочтительного состояния
3)		имитационной модели
4)		анализа чувствительности

Задание №12		
Основной целью какого вида анализа является оценка суммы и уровня среднего остатка денежных активов с позиции обеспечения платежеспособности предприятия?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Анализа собственных средств
2)		Анализа денежных активов предприятия в предшествующем периоде
3)		Анализа совокупного капитала предприятия
4)		Анализа пассивов предприятия

Задание №13		
Для расчета коэффициента участия денежных активов в совокупных оборотных активах используют		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		произведение среднего совокупного остатка денежных активов предприятия за рассматриваемый период и средней суммы оборотных активов
2)		отношение суммы оборотных активов к сумме внеоборотных активов
3)		отношение среднего совокупного остатка денежных активов предприятия за рассматриваемый период к средней сумме оборотных активов

4)		произведение оборотных активов и суммы внеоборотных активов

Задание №14		
Обратным показателем среднего периода оборота денежных активов является		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		средний остаток совокупных денежных активов
2)		коэффициент рентабельности краткосрочных финансовых инвестиций
3)		количество оборотов среднего остатка денежных активов
4)		коэффициент вариации поступления денежных средств

Задание №15		
В какой модели исходные положения предусматривают наличие определенного размера страхового запаса и определенную неравномерность в поступлении и расходовании денежных средств, а соответственно и остатка денежных активов?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Модель Миллера – Орра
2)		Модель Баумоля
3)		Модель Тобина
4)		Модель Марковица

Задание №16		
В какой модели исходными положениями является постоянство потока расходования денежных средств, хранение всех резервов денежных активов в форме краткосрочных финансовых инвестиций и изменение остатка денежных активов от их максимума и минимума, равного нулю?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Модель Миллера – Орра
2)		Модель Баумоля
3)		Модель Тобина
4)		Модель Марковица

Задание №17		
Выберите верное суждение.		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Хроническая нехватка оборотных активов позволяет предприятиям формировать остаток денежных средств в необходимых размерах с учетом их резерва
2)		Замедление платежного оборота не вызывает колебаний в размерах денежных поступлений
3)		Хроническая нехватка оборотных активов не позволяет предприятиям формировать остаток денежных средств в необходимых размерах с учетом их резерва; замедление платежного оборота вызывает значительные колебания в размерах денежных поступлений, что соответственно отражается и на сумме остатка денежных активов

4)		Ускорение платежного оборота вызывает значительные колебания в размерах денежных поступлений, что соответственно отражается и на сумме остатка денежных активов

Задание №18		
Определение потребности в страховом остатке денежных активов осуществляется		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		исходя из финансовых возможностей предприятия только после того, как полностью обеспечена потребность в других видах остатков денежных активов
2)		на основе рассчитанной суммы их операционного остатка и коэффициента неравномерности поступления денежных средств
3)		в размере, который определен соглашением о банковском обслуживании
4)		на основе рассчитанной суммы их операционного остатка и коэффициента ликвидности

Задание №19		
Что не относится к основным направлениям оптимизации денежного потока?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Максимизация чистого денежного потока
2)		Синхронизация денежных потоков во времени
3)		Минимизация чистого денежного потока
4)		Сбалансирование объемов денежных потоков

Задание №20		
Отрицательные последствия дефицитного денежного потока проявляются		
Выберите несколько из 4 вариантов ответа:		
1)		в росте просроченной кредиторской задолженности
2)		в потере реальной стоимости временно неиспользуемых денежных средств от инфляции
3)		в потере потенциального дохода от неиспользуемой части денежных активов в сфере краткосрочного их инвестирования
4)		в снижении ликвидности и уровня платежеспособности

Задание №21		
Какой из показателей характеризует риск на единицу ожидаемого результата?		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		Дисперсия
2)		Стандартное отклонение
3)		Коэффициент вариации
4)		Среднее ожидаемое значение

Задание №22
Инвестор купил европейский трехмесячный опцион пут на акцию с ценой исполнения 100 руб. за 5 руб. К моменту окончания контракта спотовая цена акции составила 98 руб.

Определите финансовый результат операции для инвестора.		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		5 руб.
2)		–5 руб.
3)		3 руб.
4)		–3 руб.
Задание №23		
Мукомольная фабрика планирует через полгода закупить зерно, однако опасается роста цены на данный актив. Что может сделать компания, чтобы захеджировать риск роста цены?		
Выберите несколько из 4 вариантов ответа:		
1)		Купить на бирже определённое количество опционных контрактов колл на зерно
2)		Продать на бирже определённое количество опционных контрактов колл на зерно
3)		Купить на бирже определённое количество опционных контрактов пут на зерно
4)		Продать на бирже определённое количество опционных контрактов пут на зерно
Задание №24		
Максимальная прибыль продавца опциона – это		
Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		премия
2)		внутренняя стоимость
3)		временная стоимость
4)		цена-страйк
Задание №25		
Фермер планирует через полгода продать зерно, однако опасается снижения цены на данный актив. Что может сделать фермер, чтобы захеджировать риск снижения цены?		
Выберите несколько из 4 вариантов ответа:		
1)		Купить на бирже определённое количество опционных контрактов колл на зерно
2)		Продать на бирже определённое количество опционных контрактов колл на зерно
3)		Купить на бирже определённое количество опционных контрактов пут на зерно
4)		Продать на бирже определённое количество опционных контрактов пут на зерно

Задание №26
Компания планирует расплатиться по валютному кредиту через полгода, однако опасается значительного роста курса валюты. Сегодня курс валюты составляет 60 руб. Компания купила сегодня определённое количество опционных контрактов колл на страйке 62 за 3 руб. Какой курс валюты захеджировала компания, если через полгода курс валюты вырос до 70 руб.?

Выберите один из 4 вариантов ответа:		
1)		59 руб.
2)		60 руб.
3)		65 руб.
4)		70 руб.

Краткое описание и регламент выполнения

Студент выполняет все предложенные задания, система выставляет за них баллы автоматически пропорционально правильным ответам.

Критерии оценки:

Формы текущего контроля	Критерии и нормы оценки
Промежуточный тест 1	Максимальное количество баллов - 3 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 2	Максимальное количество баллов - 3 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 3	Максимальное количество баллов - 3 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 4	Максимальное количество баллов - 3 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 5	Максимальное количество баллов - 3 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 6	Максимальное количество баллов - 3 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 7	Максимальное количество баллов - 3 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Промежуточный тест 8	Максимальное количество баллов – 3 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)
Итоговый тест	Максимальное количество баллов - 40 б. (баллы студенту начисляются автоматически пропорционально выполненным тестовым заданиям)

7.2.2. Задания

Задание 1

Написать эссе на тему современное информационное обеспечение управления финансовыми рисками предприятия. Объем эссе 2-5 страниц.

Задание 2

Задача 1. Проанализируйте перечень возможных внутриотраслевых рисков, связанных с деятельностью компании (варианты представлены в таблице), оцените вероятность их наступления, основываясь на основе предлагаемой системы оценки рисков, сформулируйте рекомендации.

Номер варианта	**Первая буква фамилии**	**Компания**
1.	**А,Б,В**	https://www.vtb24.ru
2.	**Г,Д,Е,Ё**	http://www.gazprom.ru
3.	**Ж,З,И**	http://www.alrosa.ru
4.	**К,Л**	http://www.aeroflot.ru
5.	**М,Н,О,**	http://www.rzd.ru
6.	**П,Р,С**	http://www.surgutneftegas.ru
7.	**Т, У,Ф**	https://alfabank.ru/#internet-bank http://www.e-disclosure.ru/portal/company.aspx?id=1389
8.	**Х,Ц,Ч,**	http://www.nornik.ru/investoram
9.	**Ш,Щ,Э**	http://www.reso.ru
10.	**Ю,Я**	http://www.danone.ru/ssylki-v-podvale/dopolnitelnaja-informacija/investoram.html

Исследование риска целесообразно проводить в следующей последовательности:

– выявление объективных и субъективных факторов, влияющих на конкретный вид риска;

– анализ выявленных факторов;

– оценка конкретного вида риска с финансовых позиций, определяющая либо финансовую состоятельность проекта, либо его экономическую целесообразность;

– установка допустимого уровня риска;

– анализ отдельных операций по выбранному уровню риска;

– разработка мероприятий по снижению риска.

Задание 3

Решить задачу. На основании расчетов по проекту строительства делового центра были получены следующие значения критериев его эффективности:

- чистый дисконтированный доход *NPV* = 3900 тыс. руб.;
- внутренняя ставка доходности проекта *IRR* = 30%;
- дисконтированный срок окупаемости инвестиций *DPP* = 4,5 года.

В ходе проведения стресс-тестирования и изменения переменных, оказывающих влияние на проект, были получены новые значения критериев его эффективности, приведённые в таблице.

Новые значения критериев эффективности проекта

Переменные	Изменение переменной	Новые значения		
		NPV	*IRR*	*DPP*
Ставка %	10%	3500	25	4,7
Постоянные издержки	8%	3850	21	4,9
Ликвидационная стоимость	5%	3800	28	5,3
Переменные издержки	4%	3400	23	5,1
Объем реализации	6%	3100	26	4,6

Цена реализации	7%	2600	22	5,2

Проведите анализ чувствительности проекта по критерию *NPV* и на основании расчетов постройте розу (звезду) рисков проекта

Задание 4

1. Фермер желает застраховаться от возможного падения цен на зерно через три месяца и зафиксировать будущую цену продажи. Опишите механизм хеджирования и механизм формирования финансового результата хеджера, если в качестве инструмента хеджирования фермер выбрал форвардный контракт.

2. Предприятию через шесть месяцев необходимо приобрести крупную партию стали, однако оно опасается роста цены на металл и хочет оставить её неизменной. Опишите механизм хеджирования и механизм формирования финансового результата хеджера, если в качестве инструмента хеджирования выбран товарный своп.

3. Компания имеет крупный кредит в валюте, по которому необходимо внести последний платёж через три месяца. Ввиду нестабильной ситуации в экономике компания остерегается роста курса валюты и желает зафиксировать курс валюты уже сегодня. Опишите механизм хеджирования и механизм формирования финансового результата хеджера, если в качестве инструмента хеджирования выбран фьючерсный контракт.

Краткое описание и регламент выполнения

Студент прикрепляет выполненные задания в системе ДОТ, преподаватель оценивает задания каждого студента индивидуально согласно критериям оценки.

В случае, если задание выполнено неверно, преподаватель может вернуть его на доработку.

Критерии оценки:

Формы текущего контроля	Критерии и нормы оценки
Задание 1	7 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 5 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 4 балла – задание выполнено в полном объёме, есть незначительные замечания 2 балла - задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 2	9 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 6 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 4 балла – задание выполнено в полном объёме, есть незначительные замечания 2 балла - задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 3	8 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 6 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы

	4 балла – задание выполнено в полном объёме, есть незначительные замечания 2 балла - задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено
Задание 4	8 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, сделаны выводы 6 баллов – задание выполнено в полном объёме согласно инструкции, отсутствуют выводы 4 балла – задание выполнено в полном объёме, есть незначительные замечания 2 балла - задание выполнено не в полном объёме, присутствуют существенные замечания 0 баллов – задание не выполнено

7.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

7.3.1. Вопросы к промежуточной аттестации

Семестр 6

№ п/п	Вопросы к экзамену
1	Развитие теории риска в процессе эволюции экономической мысли.
2	Характеристика риска как объекта финансового управления предприятием.
3	Классификация финансовых рисков предприятия.
4	Экономическая сущность управления финансовыми рисками предприятия.
5	Цель и задачи управления финансовыми рисками предприятия.
6	Функции управления финансовыми рисками предприятия.
7	Механизм управления финансовыми рисками предприятия.
8	Этапы процесса управления финансовыми рисками предприятия.
9	Факторы, генерирующие финансовые риски предприятия.
10	Сущность информационной системы финансового риск-менеджмента и ее пользователи.
11	Требования, предъявляемые к финансовой информации при принятии рисковых решений.
12	Система показателей информационного обеспечения риск-менеджмента, формируемых из внешних и внутренних источников.
13	Сущность и формы риск-анализа финансовой деятельности предприятия.
14	Основные системы риск-анализа (горизонтальный, вертикальный, сравнительный, интегральный, анализ коэффициентов).
15	Сущность и основные задачи системы риск-планирования финансовой деятельности предприятия.
16	Основные системы финансового риск-планирования (перспективное, текущее и оперативное).
17	Сущность и функции системы риск-контроллинга финансовой деятельности предприятия.
18	Принципы построения системы финансового риск-контроллинга.
19	Основные этапы построения финансового риск-контроллинга на предприятии.
20	Виды финансового риск-контроллинга (стратегический, текущий, оперативный).
21	Методический инструментарий оценки стоимости денег по простым и сложным процентам.
22	Методический инструментарий оценки стоимости денег при аннуитете.
23	Методический инструментарий прогнозирования годового темпа и индекса инфляции.
24	«Матрица решений» в процессе принятия решения в условиях риска и неопределенности.
25	«Матрица полезности» в процессе принятия решения в условиях риска и неопределенности на основе «функции полезности Неймана-Монгерштерна».
26	Критерий Вальда (критерий «максимина») принятия рисковых решений в условиях неопределенности.
27	Критерий максимакса принятия рисковых решений в условиях неопределенности.
28	Критерий Гурвица (критерий «оптимизма-пессимизма» принятия рисковых решений в условиях неопределенности).
29	Критерий Сэвиджа (критерий потерь от «минимакса») принятия рисковых решений в условиях неопределенности.

№ п/п	Вопросы к экзамену
30	Внутренняя финансовая среда предприятия: сущность, факторы.
31	Модель внутренней финансовой позиции предприятия (SWOT-анализ).
32	Финансовая политика предприятия: сущность, типы.
33	Финансовые инструменты с целью снижения и нейтрализации финансовых рисков предприятия.
34	Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков.
35	Хеджирование финансовых рисков предприятия.
36	Диверсификация и самострахование финансовых рисков предприятия.
37	Страхование финансовых рисков предприятия: сущность и принципы.
38	Классификация страхования финансовых рисков предприятия.
39	Оптимизация состава внеоборотных и оборотных активов предприятия как метод снижения риска финансовой неустойчивости предприятия.
40	Оптимизация соотношения собственного и заемного капитала предприятия как метод снижения риска финансовой неустойчивости предприятия.
41	Риск неплатежеспособности предприятия: сущность, этапы управления денежными потоками.
42	Направления оптимизации денежных потоков: сбалансирование объемов денежных потоков.
43	Направления оптимизации денежных потоков: синхронизация денежных потоков во времени.
44	Направления оптимизации денежных потоков: максимизация чистого денежного потока.
45	Управление текущей дебиторской задолженностью предприятия как метод снижения риска предприятия.
46	Направления нейтрализации проектных рисков.
47	Сущность и задачи антикризисного финансового управления предприятием.
48	Этапы процесса антикризисного финансового управления предприятием.
49	Этапы осуществления фундаментальной диагностики финансового кризиса предприятия.
50	Внешние факторы, обуславливающие кризисное финансовое развитие предприятия.
51	Внутренние факторы, обуславливающие кризисное финансовое развитие предприятия.
52	Основные этапы финансовой стабилизации предприятия.
53	Временная оптимизация инвестиционных проектов
54	Пространственная оптимизация инвестиционных проектов
55	Модель CAPM
56	Теорема разграничения Фишера
57	Модель Баумоля
58	Модель Миллера-Ора
59	Показатели эффективности управления дебиторской задолженностью
60	Политика управления дебиторской задолженностью. Формирование резерва по сомнительным долгам

7.3.2. Критерии и нормы оценки

Семестр	Форма проведения промежуточной аттестации	Критерии и нормы оценки	
6	Экзамен (по	Отлично (зачтено)	Студент набрал 85 и более баллов

Семестр	Форма проведения промежуточной аттестации	Критерии и нормы оценки	
	накопительному рейтингу)		по накопительному рейтингу
		Хорошо (зачтено)	Студент набрал от 70 до 84 баллов по накопительному рейтингу
		Удовлетворительно (зачтено)	Студент набрал от 55 до 69 баллов по накопительному рейтингу
		Неудовлетворительно (не зачтено)	Студент набрал 54 и менее баллов по накопительному рейтингу

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

8.1. Обязательная литература

№ п/п	Авторы, составители	Заглавие (заголовок)	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, др.)	Год издания	Количество в научной библиотеке / Наименование ЭБС
1	Антонов Г. Д., Иванова О.П., Тумин В.М.	Управление рисками организации	учебник	2020	ЭБС "ZNANIUM.COM"
2	Рыхтикова Н.А.	Анализ и управление рисками организации	учебное пособие	2019	ЭБС "ZNANIUM.COM"
3	Савицкая Г. В.	Комплексный анализ хозяйственной деятельности предприятия	учебник	2020	ЭБС "ZNANIUM.COM"

8.2. Дополнительная литература

№ п/п	Авторы, составители	Заглавие (заголовок)	Тип (учебник, учебное пособие, учебно-методическое пособие, практикум, др.)	Год издания	Количество в научной библиотеке / Наименование ЭБС
1	Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С.	Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия	учебно-методическое пособие	2019	ЭБС "ZNANIUM.COM"
2	Шапкин А.С., Шапкин В.А.	Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций	практическое пособие	2020	ЭБС "ZNANIUM.COM"

8.3. Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем

– КонсультантПлюс — Режим доступа к журн.: http://www.consultant.ru/

– Гарант.РУ [Электронный ресурс] : информационно-правовой портал — Режим доступа к журн.: http://www.garant.ru/

– Scopus[Электронный ресурс] : реферативная база данных. – Netherlands: Elsevier, 2004– . – Режим доступа : scopus.com. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

– Elibrary[Электронный ресурс] : научная электронная библиотека. – Москва : НЭБ, 2000– . – Режим доступа : elibrary.ru. – Загл. с экрана. – Яз. рус., англ.

– Бухгалтерский учет. Налоги. Аудит Audit [Электронный ресурс] : информационно-правовой портал — Режим доступа к журн.: http://www.audit-it.ru/

8.4. Перечень программного обеспечения

№ п/п	Наименование ПО	Реквизиты договора (дата, номер, срок действия)
1	Windows	Договор № 690 от 19.05.2015г., срок действия - бессрочно
2	Office Standart	Договор № 690 от 19.05.2015г., срок действия - бессрочно; Договор № 727 от 20.07.2016г., срок действия - бессрочно

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

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий, помещений для самостоятельной работы обучающихся (номер аудитории)	Перечень основного оборудования
1	Аудитория вебконференций. Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа. Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации. (Э-705)	Стол преподавательский, экран телевизионный, роутер, стойка для телевизора, веб.камера, транспарант-перетяжка, ширма,наушники, компьютер с выходом в Интернет.
2	Аудитория вебконференций Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа. Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа. Учебная аудитория для курсового проектирования (выполнения курсовых работ). Учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных	Стол преподавательский, экран телевизионный, роутер, стойка для телевизора, веб.камера, транспарант-перетяжка, ширма,наушники, компьютер с выходом в Интернет.

№ п/п	Наименование оборудованных учебных кабинетов, лабораторий, мастерских и др. объектов для проведения практических и лабораторных занятий, помещений для самостоятельной работы обучающихся (номер аудитории)	Перечень основного оборудования
	консультаций. Учебная аудитория для проведения занятий текущего контроля и промежуточной аттестации. (Э-405)	
3	Помещение для самостоятельной работы студентов (Г-401)	Столы ученические, стулья ученические, ПК с выходом в сеть Интернет