

Частное образовательное учреждение высшего образования
"Ростовский институт защиты предпринимателя"

(г. Ростов-на-Дону)

УТВЕРЖДАЮ

Ректор
Паршина А.А.

Финансовые риски и финансовый инжиниринг
рабочая программа дисциплины (модуля)

Учебный план 38.03.01_ОФО_2023 ФБ.plx
38.03.01 Экономика
профиль: Финансовая безопасность, анализ и мониторинг

Квалификация **бакалавр**
Форма обучения **очная**
Общая трудоемкость **3 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 108
в том числе:
аудиторные занятия 32
самостоятельная работа 74
контактная работа во время
промежуточной аттестации (ИКР) 0,1
часов на контроль 1,9

Виды контроля в семестрах:
зачеты 7

Распределение часов дисциплины по семестрам

| Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>) | 7 (4.1) | | Итого | |
|---|---------|------|-------|------|
| | уп | рп | уп | рп |
| Неделя | 17 3/6 | | | |
| Вид занятий | уп | рп | уп | рп |
| Лекции | 16 | 16 | 16 | 16 |
| Практические | 16 | 16 | 16 | 16 |
| Иная контактная работа | 0,1 | 0,1 | 0,1 | 0,1 |
| Итого ауд. | 32 | 32 | 32 | 32 |
| Контактная работа | 32,1 | 32,1 | 32,1 | 32,1 |
| Сам. работа | 74 | 74 | 74 | 74 |
| Часы на контроль | 1,9 | 1,9 | 1,9 | 1,9 |
| Итого | 108 | 108 | 108 | 108 |

Программу составил(и):
кэн, Доцент, Оленева С.В.

Рецензент(ы):
д.э.н., Епифанова Т.В.

Рабочая программа дисциплины
Финансовые риски и финансовый инжиниринг

разработана в соответствии с ФГОС ВО:
Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки
38.03.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954)

составлена на основании учебного плана:
38.03.01 Экономика
профиль: Финансовая безопасность, анализ и мониторинг
утвержденного учёным советом вуза от 29.06.2023 протокол № 35.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры
Экономика и таможенное дело

Протокол от 31.05.2023 г. № 10

Зав. Кафедрой Денисова И.П.

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

| | |
|-----|---|
| 1.1 | формирование знаний и навыков конструирования сложных финансовых продуктов для управления рисками, ликвидностью и доходностью, создания новых финансовых инструментов, разработки комбинированных инвестиционных стратегий, изучение теории практики финансовой инженерии |
|-----|---|

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

| | | |
|-------------------|---|------------|
| Цикл (раздел) ОП: | | Б1.В.ДЭ.03 |
| 2.1 | Требования к предварительной подготовке обучающегося: | |
| 2.1.1 | Технологическая (проектно-технологическая) практика | |
| 2.1.2 | Финансы | |
| 2.1.3 | Финансовое право | |
| 2.1.4 | Налоги и налоговые риски | |
| 2.2 | Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее: | |
| 2.2.1 | Бизнес задачи в реальных условиях | |
| 2.2.2 | Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы | |
| 2.2.3 | Преддипломная практика | |

3. ФОРМИРУЕМЫЕ КОМПЕТЕНЦИИ И ИНДИКАТОРЫ ИХ ДОСТИЖЕНИЯ

| | |
|--|--|
| В результате освоения дисциплины (модуля) обучающийся должен: | |
| 3.1 Знать | |
| Основные виды финансовых инструментов и их характеристики; Участников финансовых рынков, их функции и принципы взаимодействия; Методы инвестиционного анализа и оценки финансовых рисков. | |
| 3.2 Уметь | |
| Проводить самостоятельный инвестиционный анализ и принимать инвестиционные решения; Осуществлять сбор, анализ данных для решения поставленных задач; Объяснять основные принципы функционирования финансовых рынков. | |
| 3.3 Владеть | |
| Навыками оценки и принятия эффективных стратегических финансовых решений; | |
| ПК-3: Способен осуществлять консультирование клиентов по использованию финансовых продуктов и услуг | |
| ПК-3.1: Проводит мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| Частично знает как проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| В большинстве случаев знает как проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| Свободно и уверенно знает как проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| Частично умеет проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| В большинстве случаев умеет проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| Свободно и уверенно умеет проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| Частично способен проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| В большинстве случаев способен проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| Свободно и уверенно способен проводить мониторинг конъюнктуры рынка банковских услуг, рынка ценных бумаг, иностранной валюты, товарно-сырьевых рынков | |
| ПК-3.2: Осуществляет подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультирование клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов | |
| Частично знает как осуществлять подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультировать клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов | |
| В большинстве случаев знает как осуществлять подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультировать клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов | |

| |
|---|
| Свободно и уверенно знает как осуществлять подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультировать клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов |
| Частично умеет осуществлять подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультировать клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов |
| В большинстве случаев умеет осуществлять подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультировать клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов |
| Свободно и уверенно осуществлять подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультировать клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов |
| Частично способен осуществлять подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультировать клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов |
| В большинстве случаев способен осуществлять подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультировать клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов |
| Свободно и уверенно способен осуществлять подбор в интересах клиента поставщиков финансовых услуг и консультировать клиента по ограниченному кругу финансовых продуктов |
| ПК-3.3: Проводит консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |
| Частично знает как проводить консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |
| В большинстве случаев знает как проводить консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |
| Свободно и уверенно знает как проводить консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |
| Частично умеет проводить консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |
| В большинстве случаев умеет проводить консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |
| Свободно и уверенно знает как проводить консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |
| Частично способен проводить консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |
| В большинстве случаев способен проводить консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |
| Свободно и уверенно способен проводить консультирование клиента по оформлению сделок с поставщиками финансовой услуги (кроме операционной деятельности) |

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

| Код занятия | Наименование разделов и тем /вид занятия/ | Семестр / Курс | Часов | Компетенции | Литература и эл. ресурсы | Инте ракт. | Примечание |
|-------------|---|----------------|-------|----------------------|-------------------------------------|------------|------------|
| | Раздел 1. | | | | | | |
| 1.1 | Введение в финансовую инженерию /Тема/ | 7 | 0 | | | | |
| 1.2 | /Лек/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.3 | /Пр/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.4 | /Ср/ | 7 | 9 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.5 | Основные продукты финансовой инженерии (учет интересов инвесторов) /Тема/ | 7 | 0 | | | | |
| 1.6 | /Лек/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |

| | | | | | | | |
|------|---|---|-----|----------------------|-------------------------------------|--|--|
| 1.7 | /Пр/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.8 | /Ср/ | 7 | 10 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.9 | Конструирование финансовых продуктов на рынке долговых обязательств /Тема/ | 7 | 0 | | | | |
| 1.10 | /Лек/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.11 | /Пр/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.12 | /Ср/ | 7 | 10 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.13 | Секьюритизация. /Тема/ | 7 | 0 | | | | |
| 1.14 | /Лек/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.15 | /Пр/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.16 | /Ср/ | 7 | 9,1 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.17 | Финансовая инженерия на рынке долевых ценных бумаг /Тема/ | 7 | 0 | | | | |
| 1.18 | /Лек/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.19 | /Пр/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.20 | /Ср/ | 7 | 10 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.21 | Финансовые инновации на фондовом рынке. Мировой опыт и российская практика /Тема/ | 7 | 0 | | | | |
| 1.22 | /Лек/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.23 | /Пр/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |

| | | | | | | | |
|------|---|---|-----|----------------------|-------------------------------------|--|--|
| 1.24 | /Ср/ | 7 | 10 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.25 | Идентификация и оценка финансовых рисков /Тема/ | 7 | 0 | | | | |
| 1.26 | /Лек/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.27 | /Пр/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.28 | /Ср/ | 7 | 10 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.29 | Построение рискового профиля компании /Тема/ | 7 | 0 | | | | |
| 1.30 | /Лек/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.31 | /Пр/ | 7 | 2 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.32 | /Ср/ | 7 | 5,9 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.33 | /ИКР/ | 7 | 0,1 | ПК-3.1 ПК-3.2 ПК-3.3 | Л1.1 Л1.2Л2.1Л3.1 Э1 Э2 Э3 Э4 | | |
| 1.34 | /Зачёт/ | 7 | 1,9 | | | | |

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

5.1. Контрольные вопросы и задания

Дайте ответы на следующие тестовые задания:

Тест 1.1

Финансовый инжиниринг основывается на:

1. Иерархии, исполнительной дисциплины, соблюдении инструкций, законов, положений;
2. Принципах свободы экономического выбора;
3. Сочетании общего и стратегического менеджмента, менеджмента персонала, финансового менеджмента, организационного менеджмента;
4. Определенных методах, предусматривает разработку инновационных финансовых решений;

Тест 1.2

Какие бывают финансовые инструменты:

1. Концептуальные и физические средства;
2. Физические средства;
3. Концептуальные средства;

Тест 1.3

В каком году появился термин «финансовый инжиниринг»

1. 1991;
2. 1992;
3. 1993;
4. 1994;

Тест 1.4

Основными сферами финансового инжиниринга являются:

1. Финансы акционерных компаний;
2. Торговля и управление рисками;
3. Управление долгосрочными и краткосрочными вложениями денежных средств

4. Все перечисленные**Тест 1.5**

Согласно определению Дж. Финерти «Финансовый инжиниринг» это:

1. Проектирование, разработка и реализация инновационных финансовых инструментов и процессов, а также творческий поиск новых подходов к решению проблем в сфере финансов;
2. Комбинирование финансовых инструментов с различными параметрами риска и доходности для реализации инвестиционной стратегии бизнеса;
3. Комплекс мер финансового воздействия, в том числе, но не ограничиваясь, процессом целенаправленной разработки новых финансовых инструментов или новых схем осуществления финансовых операций, разработкой системы финансового управления и минимизации финансовых рисков, разработкой новых финансовых инструментов и операционных схем, пригодных при осуществлении финансово-кредитных операций;

Тест 2.1

Не является финансовым инновациям:

1. Качественное изменение в представлениях о финансовых инструментах;
2. Создание нового инструмента с применением ранее известных технологий;
3. Новое использование известной идеи;
4. Использование нового программного обеспечения;

Тест 2.2

Наиболее правильное определение «банковской инновации» это:

1. Ранее не существовавший продукт или услуга;
2. Система разноаспектных нововведений в любой сфере функционирования банка, обладающих определенным положительным экономико-стратегическим эффектом;

Тест 2.3

Исходя из классификационного признака «по временному аспекту» банковские инновации делятся на:

1. Сверхновые и новые, оперативные (текущие, краткосрочные), перспективные (долгосрочные);
2. Стратегические и реактивные;
3. Точечные и системные;
4. Инфотехнологические, продуктовые и организационные;
5. Адаптивные, функциональные, фундаментальные;
6. Управленческие, организационные, социальные;
7. Научные, технические, технологические и информационные;
8. Быстрые, замедленные, нарастающие, затухающие, равномерные, скачкообразные;
9. Высокие, низкие, стабильные;
10. Экономические и социальные;
11. Радикальные (базовые), улучшающие, модификационные (частные);

Тест 2.4

Исходя из классификационного признака «по причинам зарождения» банковских инновации делятся на:

1. Сверхновые и новые, оперативные (текущие, краткосрочные), перспективные (долгосрочные);
2. Стратегические и реактивные;
3. Точечные и системные;
4. Инфотехнологические, продуктовые и организационные;
5. Адаптивные, функциональные, фундаментальные;
6. Управленческие, организационные, социальные;
7. Научные, технические, технологические и информационные;
8. Быстрые, замедленные, нарастающие, затухающие, равномерные, скачкообразные;
9. Высокие, низкие, стабильные;
10. Экономические и социальные;
11. Радикальные (базовые), улучшающие, модификационные (частные);

Тест 2.5

Исходя из классификационного признака «по объему воздействия» банковских инновации делятся на:

1. Сверхновые и новые, оперативные (текущие, краткосрочные), перспективные (долгосрочные);
2. Стратегические и реактивные;
3. Точечные и системные;
4. Инфотехнологические, продуктовые и организационные;
5. Адаптивные, функциональные, фундаментальные;
6. Управленческие, организационные, социальные;
7. Научные, технические, технологические и информационные;
8. Быстрые, замедленные, нарастающие, затухающие, равномерные, скачкообразные;
9. Высокие, низкие, стабильные;
10. Экономические и социальные;
11. Радикальные (базовые), улучшающие, модификационные (частные);

Тест 2.6

Исходя из классификационного признака «в зависимости от сферы внедрения инноваций в банке» банковских инновации делятся на:

1. Сверхновые и новые, оперативные (текущие, краткосрочные), перспективные (долгосрочные);
2. Стратегические и реактивные;
3. Точечные и системные;
4. Инфотехнологические, продуктовые и организационные;

5. Адаптивные, функциональные, фундаментальные;
6. Управленческие, организационные, социальные;
7. Научные, технические, технологические и информационные;
8. Быстрые, замедленные, нарастающие, затухающие, равномерные, скачкообразные;
9. Высокие, низкие, стабильные;
10. Экономические и социальные;
11. Радикальные (базовые), улучшающие, модификационные (частные);

Тест 2.7

Исходя из классификационного признака «по влиянию нового продукта на поведение потребителей» банковские инновации делятся на:

1. Сверхновые и новые, оперативные (текущие, краткосрочные), пер-спективные (долгосрочные);
2. Стратегические и реактивные;
3. Точечные и системные;
4. Инфотехнологические, продуктовые и организационные;
5. Адаптивные, функциональные, фундаментальные;
6. Управленческие, организационные, социальные;
7. Научные, технические, технологические и информационные;
8. Быстрые, замедленные, нарастающие, затухающие, равномерные, скачкообразные;
9. Высокие, низкие, стабильные;
10. Экономические и социальные;
11. Радикальные (базовые), улучшающие, модификационные (частные);

Тест 2.8

Исходя из классификационного признака «область применения» банковские инновации делятся на:

1. Сверхновые и новые, оперативные (текущие, краткосрочные), перспективные (долгосрочные);
2. Стратегические и реактивные;
3. Точечные и системные;
4. Инфотехнологические, продуктовые и организационные;
5. Адаптивные, функциональные, фундаментальные;
6. Управленческие, организационные, социальные;
7. Научные, технические, технологические и информационные;
8. Быстрые, замедленные, нарастающие, затухающие, равномерные, скачкообразные;
9. Высокие, низкие, стабильные;
10. Экономические и социальные;
11. Радикальные (базовые), улучшающие, модификационные (частные);

Тест 2.9

Исходя из классификационного признака «результат научно-исследовательских разработок» банковские инновации делятся на:

1. Сверхновые и новые, оперативные (текущие, краткосрочные), пер-спективные (долгосрочные);
2. Стратегические и реактивные;
3. Точечные и системные;
4. Инфотехнологические, продуктовые и организационные;
5. Адаптивные, функциональные, фундаментальные;
6. Управленческие, организационные, социальные;
7. Научные, технические, технологические и информационные;
8. Быстрые, замедленные, нарастающие, затухающие, равномерные, скачкообразные;
9. Высокие, низкие, стабильные;
10. Экономические и социальные;
11. Радикальные (базовые), улучшающие, модификационные (частные);

Тест 2.10

Исходя из классификационного признака «темпы осуществления» банковские инновации делятся на:

1. Сверхновые и новые, оперативные (текущие, краткосрочные), перспективные (долгосрочные);
2. Стратегические и реактивные;
3. Точечные и системные;
4. Инфотехнологические, продуктовые и организационные;
5. Адаптивные, функциональные, фундаментальные;
6. Управленческие, организационные, социальные;
7. Научные, технические, технологические и информационные;
8. Быстрые, замедленные, нарастающие, затухающие, равномерные, скачкообразные;
9. Высокие, низкие, стабильные;
10. Экономические и социальные;
11. Радикальные (базовые), улучшающие, модификационные (частные).

5.2. Темы письменных работ

Темы рефератов:

1. Понятие и сущность финансового инжиниринга.
2. Цели финансового инжиниринга.
3. Основные субъекты и объекты финансового инжиниринга.
4. Виды и классификации финансового инжиниринга.

5. Роль и значение финансового инжиниринга.
6. Необходимость применения финансового инжиниринга.
7. Основные потребители финансового инжиниринга: инвесторы и эмитенты.
8. Сущность банковских инноваций.
9. Виды и классификация банковских инноваций.
10. Банковский инжиниринг как процесс создания банковских инноваций.
11. Теоретические подходы к исследованию сущности банковских инноваций.
12. Стратегии и технология разработки банковских инноваций.
13. Основные направления банковских инноваций в Российской Федерации.
14. Основные продукты финансового инжиниринга.
15. Систематизация инновационных финансовых продуктов.
16. Гибридные и структурированные финансовые продукты.
17. Продукты финансового инжиниринга на долевым и долговом рынках.
18. Список Финнерти.
19. Примеры гибридных и структурированных финансовых продуктов.
20. Синтетические финансовые продукты.
21. Аутсорсинг управления риском.
22. Методы финансирования рисков.
23. Пороговые значения риска.
24. Общая характеристика информации, необходимой для управления риском.
25. Идентификация и анализ рисков.
26. Меры по предотвращению неплатежеспособности и несостоятельности российских предприятий.
27. Реструктуризация предприятия: подходы и решения.
28. Правовое регулирование отношений в сфере несостоятельности (банкротства).
29. Анализ результатов развития предприятия в условиях быстро меняющейся внешней среды.
30. Пути реструктуризации предприятия с учетом зарубежного опыта.
31. Взгляды экономистов на теорию циклов и кризисов.
32. Методы антирискового регулирования экономики.
33. Причины, факторы и симптомы кризисного развития экономики.
34. Диагностика банкротства предприятий.
35. Зарубежная практика риск-менеджмента.
36. Основные стратегии вывода предприятия из кризиса.
37. Классификация антикризисных стратегий.
38. Меры по восстановлению платежеспособности должника.
39. Выбор оптимального объема производства в условиях неопределенности спроса.
40. Институциональные особенности принятия решений в переходной экономике.

Контрольно-практическое задание: Классификация рисков

Дан следующий перечень рисков.

- 1) Риск аварии грузового судна во время перевозки груза, ожидаемого компанией.
- 2) Риск слишком резкого снижения курса USD для компании, осуществляющей экспортные операции.
- 3) Риск возникновения сбоя в поставках сырья.
- 4) Риск снижения спроса на продукцию предприятия.
- 5) Риск отвержения рынком нового товара организации.
- 6) Риск потери прибыли в результате снижения рыночных цен на товар.
- 7) Риск просрочки выплаты долга дебитором.
- 8) Риск разрушения складского помещения фирмы в результате стихийного бедствия.
- 9) Риск поражения вирусом компьютерных сетей компании.
- 10) Риск утечки информации, представляющей коммерческую тайну.
- 11) Риск возникновения на рынке нового сильного конкурента.
- 12) Риск потери платежеспособности.
- 13) Риск превышения спросом производственных мощностей предприятия.
- 14) Риск поставки низкосортных материалов поставщиком (с большой долей брака).
- 15) Риск резкого скачка текучести кадров.
- 16) Риск остановки производства в результате выхода из строя оборудования.
- 17) Риск ухода с рынка основного потребителя продукции
- 18) Риск отказа инвестора от дальнейшего финансирования проекта в процессе его реализации.
- 19) Риск ухода ведущих специалистов компании.

5.3. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств по дисциплине включает:

- 1) оценочные средства для проведения текущего контроля успеваемости:
 - устный и письменный опрос,
 - собеседование,

- реферативное задание,
 - тестовое задание
- 2) оценочные средства для проведения промежуточной аттестации в форме: контрольных вопросов и заданий для зачета, экзамена.

5.4. Перечень видов оценочных средств

- зачеты;
- решение практических ситуаций;
- тестирование;
- доклады;
- рефераты.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год |
|------|---------------------|--|---------------------------|
| Л1.1 | Фридман А. М. | Финансы организации (предприятия): учебник | Москва: Дашков и К°, 2016 |
| Л1.2 | Поляк Г. Б. | Финансы: учебник | Москва: Юнити, 2017 |

6.1.2. Дополнительная литература

| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год |
|------|---|-----------------------------------|---------------------|
| Л2.1 | Балихина Н. В., Косов М. Е., Иванова Я. Я., Чалова А. Ю., Омшанова Э. А. | Финансы и кредит: учебное пособие | Москва: Юнити, 2017 |

6.1.3. Методические разработки

| | Авторы, составители | Заглавие | Издательство, год |
|------|-------------------------------|--|---------------------------|
| Л3.1 | Шапкин А. С., Шапкин В. А. | Экономические и финансовые риски: оценка, управление, портфель инвестиций: учебное пособие | Москва: Дашков и К°, 2018 |

6.2. Электронные учебные издания и электронные образовательные ресурсы

| | |
|----|---|
| Э1 | Статистические материалы Госкомстата, размещенные на официальном сайте |
| Э2 | Статистические материалы по Ростовской области, размещенные на официальном сайте Администрации Ростовской области |
| Э3 | Компания «Консультант Плюс» (нормативно-правовые акты) |
| Э4 | Компания «Гарант» (нормативно-правовые акты) |

6.3.2 Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем

7. МТО (оборудование и технические средства обучения)

| № | Назначение | Оборудование | ПО | Адрес | Вид |
|----|---|--|--|--|-----|
| 43 | учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, Лаборатория по бухгалтерскому учету и аудиту | Демонстрационное оборудование, учебно-наглядные пособия Специализированная мебель: стол – 18 шт., стул – 36 шт., доска – 1 шт., компьютер – 1 шт., проектор – 1 шт. | Операционная система Microsoft Windows 10 home Приложение Офис2016 Антивирус Nod 5 academic Интернет фильтр UserGade Система тестирования MyTestx.1c Предприятие 1С 8.3 Бухгалтерия 1С 8.3 Документооборот 1С 8.3 Комплект для обучения в высших и средних учебных заведений. 1С 8.3 | 344029, Ростовская область, г. Ростов-на-Дону, Первомайский район, ул. Сержантова, 2/104 | |

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Обучение по дисциплине (модулю) предполагает изучение курса на аудиторных занятиях (лекции,

практические/семинарские) и самостоятельной работы студентов. Практические/семинарские занятия дисциплины могут проводиться в различных формах с целью оценки достижения компетенций.

Подготовка к лекции студентами заключается в следующем:

- повторить материал предыдущей лекции, прочитав его повторно;
- ознакомиться с темой предстоящей лекции (в рабочей программе учебной дисциплины);
- ознакомиться с учебными материалами по данной теме в соответствии с предложенным списком литературы в рабочей программе учебной дисциплины или с электронными материалами, предложенными лектором;
- записать возможные вопросы, которые можно будет задать лектору.

Подготовка к практическим (семинарским) занятиям:

- внимательно прочитать материал лекций, относящихся и к данному занятию, ознакомиться с учебными материалами, включая электронные в соответствии с предложенным списком литературы в рабочей программе учебной дисциплины;
- подготовить развернутые ответы на вопросы, предложенные для обсуждения;
- выполнить задания, если они предусмотрены в письменной форме;
- понять, что осталось неясными и постараться получить на них ответ заранее;
- готовиться к практическим/семинарским занятиям можно как индивидуально, так и в составе малой группы;
- рабочую программу учебной дисциплины необходимо использовать в качестве основного ориентира в организации обучения;

Подготовка к промежуточной аттестации. К промежуточной аттестации необходимо готовиться целенаправленно, регулярно, систематически и с первых дней обучения по данной дисциплине. В самом начале учебного курса познакомьтесь со следующей учебно-методической документацией:

- программой дисциплины;
- тематическими планами лекций, семинарских занятий;
- учебником, учебными пособиями по дисциплине, а также электронными ресурсами;
- перечнем и тематикой письменных работ, а также методическими рекомендациями по их выполнению;
- перечнем вопросов (вопросов к зачету).