

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Кудрявцев М.Г.
Должность: Проректор по образовательной деятельности
Дата подписания: 2024.01.26
Уникальный программный ключ:
790a1a8df2525774421adc1fc96453f0e902bfb0

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
МИНИСТЕРСТВА СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
**«РОССИЙСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
ИМЕНИ В.И. ВЕРНАДСКОГО»**
(Университет Вернадского)

Кафедра Экономики и финансов

Принято Ученым советом
Университета Вернадского
«26» января 2024 г. протокол №7



Рабочая программа дисциплины
Управление финансовыми рисками

Направление подготовки 38.04.01 Экономика

Направленность (профиль) программы Экономика фирмы и отраслевых рынков

Квалификация Магистр

Форма обучения **очная**

Балашиха 2024 г.

Рабочая программа разработана в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.01 Экономика

Рабочая программа дисциплины разработана доцентом кафедры экономики и финансов, к.э.н. Макеевой Т.Ю.

Рецензент: д.э.н., профессор кафедры управления Васильева И.В.

1 Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с установленными в ОПОП ВО индикаторами достижения компетенций

1.1 Перечень компетенций, формируемых учебной дисциплиной

Код и наименование компетенции	Планируемые результаты обучения
Профессиональная компетенция	
ПК-3. Способен осуществлять стратегическое управление ключевыми показателями и бизнес процессами	Знать (З): основы разработки вариантов управленческих решений и обоснования их выбора на основе критериев финансово-экономической эффективности деятельности хозяйствующих субъектов
	Уметь (У): осуществлять руководство экономическими службами и подразделениями организации
	Владеть (В): методикой разработки стратегии поведения экономических агентов на различных рынках

2. Цели и место дисциплины в структуре ОПОП ВО

Дисциплина «Управление финансовыми рисками» относится к части формируемой участниками образовательных отношений профессиональной образовательной программы высшего образования 38.04.01 Экономика направленность (профиль) Экономика фирмы и отраслевых рынков.

Целями изучения дисциплины «Управление финансовыми рисками» является обучение финансовому риск-менеджменту в условиях современной экономики на основе использования актуальных методик современного управления рисками, формирование понятийного инструментария, понимания стратегической роли управления финансовыми рисками как бизнес-процесса в рамках организации и управления компанией. Дисциплина предполагает изучение студентами мировой практики системы формирования и развития управлением финансовыми рисками с учетом использования современных инновационных финансовых технологий.

3. Объем учебной дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий, текущий и промежуточный контроль по дисциплине) и на самостоятельную работу обучающихся

Вид учебной работы	2 семестр
Общая трудоемкость дисциплины, зачетных единиц	3
часов	108
Аудиторная (контактная) работа, часов	32,25
в т.ч. занятия лекционного типа	16
занятия семинарского типа	16
промежуточная аттестация	0,25
Самостоятельная работа обучающихся, часов	71,75
в т.ч. курсовая работа	-
Контроль	4
Вид промежуточной аттестации	зачет

4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

4.1 Перечень разделов дисциплины с указанием трудоемкости аудиторной (контактной) и самостоятельной работы, видов контролей и перечня компетенций

Наименование разделов и тем	Трудоемкость, часов			Код компетенции
	всего	в том числе		
		аудиторной (контактной) работы	самостоятельной работы	
Раздел 1. Теоретические аспекты управления финансовыми рисками	51	16	35	ПК-3
Раздел 2. Методические аспекты управления финансовыми рисками	53	16,25	36,75	
Итого за семестр	104	32,25	71,75	
Промежуточная аттестация	4	0,25	-	
ИТОГО по дисциплине	108	32,25	71,75	

4.2 Содержание дисциплины по разделам

Раздел 1. Теоретические аспекты управления финансовыми рисками

Перечень учебных элементов раздела:

Тема 1. Понятие и классификация финансовых рисков

Риски, обусловленные вероятностью, и риски, обусловленные неопределенностью. Определение субъектов, для которых возникает финансовый риск в процессе осуществления различных видов деятельности. Предпринимательские и непредпринимательские риски. Чистые и спекулятивные риски. Коммерческие и финансовые риски. Риски, связанные с покупательной способностью денег и инвестиционные риски. Систематические и несистематические риски

Тема 2. Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы

Мотивация интереса к риск-менеджменту. Основные характеристики финансового риск-менеджмента. Убыток (ущерб) и его виды. Классы убытков. Максимально возможный и максимально вероятный риск. Метод избежания рисков, метод принятия рисков на себя, метод предотвращения убытков, метод передачи риска, оптимизация риска, ограничение риска путем лимитирования операций, снижения риска путем обеспечения исполнения обязательств, хеджирование, аренда. Правило выбора стратегических методов управления рисками.

Тема 3. Управление банковскими рисками

Классификация рисков банковской деятельности. Внешние и внутренние риски. Риски пассивных и активных операций. Дискуссионные вопросы содержания рыночного риска банковской деятельности. Особенности методов управления банковскими рисками. Влияние на практике требований и нормативов ЦБ РФ на риски деятельности коммерческих банков.

Тема 4. Управление кредитным риском

Дискуссионные вопросы о структуре кредитного риска. Оценка кредитного риска. Система оценочных коэффициентов. Фундаментальный анализ эмитента и его бумаг. Формирование резерва на возможные потери по ссудам. Кредитные деривативы как способ управления кредитным риском. Понятие и виды кредитных деривативов.

Форварды, свопы, опционы, индексные инструменты как представители семейства кредитных деривативов. Факторинговое обслуживание.

Раздел 2. Методические аспекты управления финансовыми рисками

Перечень учебных элементов раздела:

Тема 5. Риск ликвидности: методы оценки и управления

Источники возникновения риска ликвидности. Ликвидность. Методы оценки риска ликвидности. Количественная оценка рыночной ликвидности. Динамика рыночной ликвидности. Факторы рыночной ликвидности. Источники риска ликвидности фондирования (балансовой ликвидности). Основные мероприятия по управлению риском ликвидности фондирования.

Тема 6. Управление процентным риском

Источники возникновения процентного риска. Риск потерь от изменения потоков денежных средств, Портфельный риск и экономический риск. Измерение процентного риска. Факторы, влияющие на процентный риск. Метод длительности, нейтрализация требований и обязательств. Метод эффективной границы. Пассивные стратегии управления портфелем ценных бумаг. Хеджирование.

Тема 7. Управление валютным риском

Особенности операционного, трансляционного и экономического валютного риска. Золотая (прямая и косвенная), валютная и мультивалютная оговорки. Симметричная, асимметричная, стандартная, регулируемая. Элементы механизма действия валютной оговорки. Сочетание понятий компенсация и управление валютными операциями многонациональной компании. Иные методы управления валютными рисками на производственных предприятиях: структурная балансировка, изменение срока платежа, параллельные ссуды, форфейтирование, самострахование, страхование, хеджирование.

Тема 8. Управление операционными рисками

Потенциальные источники операционных рисков. Расчет основных показателей деятельности компании. Анализ волатильности доходов, распределение вероятностей убытков. Особенности методов управления рисками без сокращения объемов операций и путем лимитирования. Организация использования информационных системных комплексов.

Тема 9. Управление рыночными рисками

Сущность рыночного риска. Классификация рыночных рисков по различным признакам. Концепция рисковости стоимости. Дюрация и иммунизация портфеля. VaR (Value-at-Risk) и основные методы его расчета. Методы построения функции финансового результата от изменения факторов риска. 6. Механизмы управления рыночным риском.

5. Оценочные материалы по дисциплине

Оценочные материалы по дисциплине представлены в виде фонда оценочных средств.

6. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

6.1 Перечень учебно-методического обеспечения по дисциплине

№ п/п	Автор, название, место издания, издательство, год издания, количество страниц, режим доступа

6.2 Перечень учебных изданий, необходимых для освоения дисциплины

Основная литература:

1. Пименов, Н. А. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности : учебник и практикум для вузов / Н. А. Пименов. — 3-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 353 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16342-1. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/530834>
2. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 569 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13380-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/511958>
3. Погодина, Т. В. Финансовый менеджмент : учебник и практикум для вузов / Т. В. Погодина. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 259 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-16480-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/531261>

Дополнительная литература:

1. Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие для вузов / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 129 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-13920-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/519556>

6.3 Современные профессиональные базы данных, информационные справочные системы и лицензионное программное обеспечение

Современные профессиональные базы данных, информационные справочные системы, цифровые электронные библиотеки и другие электронные образовательные ресурсы

1. Договор о подключении к Национальной электронной библиотеке и предоставлении доступа к объектам Национальной электронной библиотеки №101/НЭБ/0502-п от 26.02.2020 5 лет с пролонгацией
2. Соглашение о бесплатном тестовом доступе к Polpred.com. Обзор СМИ 27.04.2016 бессрочно
3. Соглашение о бесплатном тестовом доступе к Polpred.com. Обзор СМИ 02.03.2020 бессрочно
4. Информационно-справочная система «Гарант» – URL: <https://www.garant.ru/>
Информационно-справочная система Лицензионный договор № 261709/ОП-2 от 25.06.2021
5. «Консультант Плюс». – URL: <http://www.consultant.ru/> свободный доступ
6. Электронно-библиотечная система AgriLib <http://ebs.rgunh.ru/> (свидетельство о государственной регистрации базы данных №2014620472 от 21.03.2014).

Доступ к электронной информационно-образовательной среде, информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

1. Система дистанционного обучения Moodle www.portfolio.rgunh.ru (свободно распространяемое)
2. Право использования программ для ЭВМ Mirapolis HCM в составе функциональных блоков и модулей: Виртуальная комната.

3. Инновационная система тестирования – программное обеспечение на платформе 1С (Договор № К/06/03 от 13.06.2017). Бессрочный.
4. Образовательный интернет – портал Университета Вернадского (свидетельство о регистрации средства массовой информации Эл № ФС77-51402 от 19.10.2012).

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение

1. OpenOffice – свободный пакет офисных приложений (свободно распространяемое)
2. linuxmint.com <https://linuxmint.com/> (свободно распространяемое)
3. Электронно-библиотечная система AgriLib <http://ebs.rgunh.ru/> (свидетельство о государственной регистрации базы данных №2014620472 от 21.03.2014) собственность университета.
4. Официальная страница ФГБОУ ВО МСХ РФ «Российский государственный университет народного хозяйства имени В.И. Вернадского» <https://vk.com/rgunh.ru> (свободно распространяемое)
5. Портал ФГБОУ ВО МСХ РФ «Российский государственный университет народного хозяйства имени В.И. Вернадского» (свободно распространяемое) <https://zen.yandex.ru/id/5fd0b44cc8ed19418871dc31>
6. Антивирусное программное обеспечение Dr. WEB Desktop Security Suite (Сублицензионный договор №13740 на передачу неисключительных прав на программы для ЭВМ от 01.07.2021).

6.4 Перечень учебных аудиторий, оборудования и технических средств обучения

Учебная аудитория для проведения лекционных занятий (поточная). Специализированная мебель, доска меловая, мультимедийное оборудование, проектор, экран настенный	143907, Московская область, г. Балашиха, ул. шоссе Энтузиастов, д.50, каб. 129 Площадь помещения 118,1 кв.м № по технической инвентаризации 140, этаж 1
Учебная аудитория для занятий лекционного типа, семинарского типа (семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы), для проведения групповых консультаций и индивидуальной работы обучающихся с педагогическими работниками, для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации. Специализированная мебель, доска меловая. Мультимедийное оборудование, проектор, экран настенный	143907, Московская область, г. Балашиха, ул. шоссе Энтузиастов, д. 50, каб. 125 Площадь помещения 51,6 кв.м № по технической инвентаризации 136, этаж 1
Помещение для самостоятельной работы. Персональные компьютеры в сборке с выходом в интернет.	143907, Московская область, г. Балашиха, ул. шоссе Энтузиастов, д. 50, читальный зал Площадь помещения 497,4 кв. м. № по технической инвентаризации 177, этаж 1
Помещение для самостоятельной работы. Специализированная мебель, персональные компьютеры в сборке с выходом в интернет.	143900, Московская область, г. Балашиха, ул. Юлиуса Фучика д.1, каб. 320 Площадь помещения 49,7 кв. м. № по технической инвентаризации 313, этаж 3
Учебная аудитория для учебных занятий обучающихся из числа инвалидов и лиц с ОВЗ. Специализированная мебель. Автоматизированное рабочее место для инвалидов-колясочников с коррекционной техникой и индукционной системой ЭлСис 290; Автоматизированное рабочее место для слабовидящих и незрячих пользователей со стационарным видеоувеличителем ЭлСис 29 ON; Автоматизированное рабочее место для слабовидящих и незрячих пользователей с портативным	143907, Московская область, г. Балашиха, ул. шоссе Энтузиастов, д. 50, каб. 105 Площадь помещения 52,8 кв. м. № по технической инвентаризации 116, этаж 1

видеоувеличителем ЭлСис 207 CF; Автоматизированное рабочее место для слабовидящих и незрячих пользователей с читающей машиной ЭлСис 207 CN; Аппаратный комплекс с функцией видеоувеличения и чтения для слабовидящих и незрячих пользователей ЭлСис 207 OS.	
---	--

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
МИНИСТЕРСТВА СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
**«РОССИЙСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
ИМЕНИ В.И. ВЕРНАДСКОГО»**
(Университет Вернадского)

**Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной
аттестации обучающихся по дисциплине
Управление финансовыми рисками**

Направление подготовки 38.04.01 Экономика

Направленность (профиль) программы Экономика фирмы и отраслевых рынков

Квалификация Магистр

Форма обучения очная

Балашиха 2024 г.

1. Описание показателей и критериев оценивания планируемых результатов обучения по учебной дисциплине

Код и наименование компетенции	Уровень освоения	Планируемые результаты обучения
ПК-3. Способен осуществлять стратегическое управление ключевыми показателями и бизнес процессами	Пороговый (удовлетворительно)	<p>Знать (З): основы разработки вариантов управленческих решений и обоснования их выбора на основе критериев финансово-экономической эффективности деятельности хозяйствующих субъектов</p> <p>Уметь (У): осуществлять руководство экономическими службами и подразделениями организации</p> <p>Владеть (В): методикой разработки стратегии поведения экономических агентов на различных рынках</p>
	Продвинутый (хорошо)	<p>Знает твердо: основы разработки вариантов управленческих решений и обоснования их выбора на основе критериев финансово-экономической эффективности деятельности хозяйствующих субъектов</p> <p>Умеет уверенно: осуществлять руководство экономическими службами и подразделениями организации</p> <p>Владеет уверенно: методикой разработки стратегии поведения экономических агентов на различных рынках</p>
	Высокий (отлично)	<p>Имеет сформировавшееся систематические знания: основы разработки вариантов управленческих решений и обоснования их выбора на основе критериев финансово-экономической эффективности деятельности хозяйствующих субъектов</p> <p>Имеет сформировавшееся систематическое умение: осуществлять руководство экономическими службами и подразделениями организации</p> <p>Показал сформировавшееся систематическое владение: методикой разработки стратегии поведения экономических агентов на различных рынках</p>

Для дисциплины, формой итогового контроля которой является зачет:

«зачтено» выставляется, если студент усвоил материал по программе дисциплины, способен преобразовывать теоретические знания в профессиональные умения и навыки

«не зачтено» выставляется, если студент не усвоил материал по программе дисциплины, не способен преобразовывать теоретические знания в профессиональные умения и навыки

При очной форме обучения в результате оценивания выставляются баллы за виды

деятельности (оценочные средства) по итогам изучения модулей (разделов дисциплины), перечисленных в рейтинг-плане дисциплины. Итоговый рейтинг успеваемости студентов складывается из суммы баллов, набранных студентом за всю работу в течение семестра (включая итоговый контроль)

Шкалы оценивания для очной формы обучения:

для зачета: «зачтено» - от 60 до 110 баллов (включая 10 поощрительных баллов), «не зачтено» - менее 60 баллов При заочной и очно-заочной формах обучения в результате оценивания выставляется оценка за виды деятельности (оценочные средства) по итогам изучения модулей (разделов дисциплины), перечисленных в содержании рабочей программы.

2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ

ПРИМЕРНЫЕ ТЕМЫ РЕФЕРАТОВ

1. Риск в предпринимательской деятельности.
2. Объективная и субъективная природа риска.
3. Роль риск-менеджмента в системе управления организацией.
4. Математическая аналогия как метод идентификации риска.
5. Применение стресс-тестирования при анализе риска.
6. Преимущества и недостатки методологии Value-at-Risk.
7. Особенности и ограничения применения дельта-нормального метода вычисления VAR.
8. Понятие нормального гауссовского распределения вероятностей и его применение в оценке рыночного риска.
9. Метод исторических симуляций в оценке рыночного риска.
10. Преимущества и недостатки вычисления VAR методом Монте Карло.
11. Применение модели геометрического броуновского движения при моделировании динамики цен активов и процентных ставок.
12. Применение альфа- и бета-коэффициентов при оценке рыночного риска.
13. Дефолт как проявление кредитного риска.
14. Страновой риск как составная часть внешнего кредитного риска.
15. Индекс BERT как метод оценки уровня странового риска.
16. Цели и задачи анализа кредитоспособности заемщика.
17. Методы анализа кредитоспособности заемщика.
18. Скоринговая модель оценки кредитного риска.
19. Особенности модели CreditMetrics.
20. Применение теории экстремальных значений при оценке уровня операционного риска.

Рекомендации по подготовке докладов (рефератов).

Реферат представляет собой краткое точное изложение сущности вопроса (проблемы) на основе изучения законов, монографии, научной статьи (статей). Реферат должен содержать основные фактические сведения и выводы по рассматриваемому вопросу (проблеме).

В реферате нужны развернутые аргументы, рассуждения, сравнения. Материал подается не столько в развитии, сколько в форме констатации или описания. Содержание

реферируемого материала излагается объективно от имени автора. Если в первичном документе главная мысль сформулирована недостаточно четко, в реферате она должна быть конкретизирована и выделена. Логика написания реферата предусматривает введение, основную часть, заключение.

Таким образом, реферат является результатом самостоятельной работы магистранта с элементами научного подхода по изучению определенных источников на заданный вопрос (проблему).

Объем реферата (не включая список источников) - до 7-10 страниц компьютерного текста (шрифт 14, через 1,5 интервал). Рефераты должны быть представлены в печатном виде (требования к оформлению см. в методических рекомендациях по оформлению и написанию письменных работ), объемом не более 10 страниц, с указанием используемой литературы (не менее 5 источников). Защита рефератов проводится на семинарских занятиях в формате вопрос-ответ.

ПРИМЕРНЫЕ ТЕСТОВЫЕ ЗАДАНИЯ

1. Объект управления в системе финансового риск-менеджмента – это:

- а) риск-менеджер
- б) информация
- в) финансовый риск
- г) процесс риск-менеджмента

2. Финансовый риск – это неопределенность ...

- а) достижения поставленных целей
- б) в отношении возможного убытка
- в) выраженная в неполном контроле над результатами принятых решений

3. Модель максимизации рыночной стоимости компании...

- а) соответствует основной цели финансового риск-менеджмента
- б) противоречит основной цели финансового риск-менеджмента
- в) только частично соответствует основной цели финансового риск-менеджмента

4. Какой уровень финансового риска позволяет компании снизить вероятность потерь, избежать банкротства и получить прибыль?

- а) Минимальный
- б) Оптимальный
- в) Максимальный

5. Риск контрагента относится к категории..

- а) Рыночных рисков
- б) Кредитных рисков
- в) Рисков ликвидности

ПРИМЕРНЫЕ КЕЙСОВЫЕ ЗАДАНИЯ

Кейс «Пример управления рисками в компании CODELCO» Проанализируйте проблему, возникшую у компании Codelco.

Является ли данный кейс примером управления финансовым риском? Обоснуйте ответ. Codelco- чилийская государственная компания – крупнейшая горнодобывающая компания мира (крупнейший в мире производитель меди). В 1999-м полугодовая прибыль компании снизилась почти вдвое -до 122 млн долларов США в результате снижения цен на медь.

В течение первой половины года цена на медь составляла в среднем всего лишь 66,47 доллара/фунт, что является одним из самых низких в двадцатом веке. В то время на долю государственного концерна приходилось 15% мирового производства продукции. Продажи компании снизились на 7 процентов по сравнению с предыдущим полугодовым периодом, несмотря на рост объемов продаж на 5,5 процентов по сравнению с

аналогичным периодом в предыдущем году. Ситуация была бы еще хуже, если бы не руководители Codelco, которые приступили к осуществлению радикального плана сокращения расходов, предусматривающего сокращение рабочих мест и замораживание заработной платы на пяти шахтах концерна. В результате прямые производственные затраты сократились с 44,3 центов / фунт до 41,3 центов/фунтов.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Примерная тематика вопросов для промежуточной аттестации (зачет)

1. Система управления финансовыми рисками и предпосылки для ее развития
2. Финансовый риск-менеджмент и его влияние на платежеспособность компании.
3. Развитие теории риска
4. Сущность понятия неопределенность и риск.
5. Понятие и структура финансового рынка
6. Посредники на финансовом рынке и их функции
7. Базовые концепции и принципы управления финансовыми рисками.
8. Сущность тактики управления финансовым риском.
9. Этапы процесса управления финансовыми рисками.
10. Источники информации для анализа и оценки финансовых рисков
11. Алгоритм управления финансовыми рисками
12. Источники информации о рисках в финансовом риск-менеджмента
13. Подходы к классификации финансовых рисков.
14. Характеристики финансовых рисков
15. Общие характеристики инструментов, используемых для управления финансовыми рисками.
16. Меры снижения степени финансового риска.
17. Рыночный риск, его сущность и виды.
18. Кредитный риск, его сущность и разновидности.
19. Понятие и виды дефолта.
20. Процедура оценки вероятности наступления дефолта.
21. Классический анализ кредитоспособности.
22. Риск ликвидности, его сущность, классификация, оценка, взаимосвязи с другими финансовыми рисками.
23. Методы управления кредитным риском в нефинансовых организациях
24. Методы управления кредитным риском в финансовых организациях
25. Управление риском ликвидности в нефинансовых организациях.
26. Управление валютными рисками.
27. Понятие операционного риска и методы управления им.
28. Основные показатели рыночного риска. Расчет показателя волатильности финансовых индикаторов.
29. Классификация методов оценки финансовых рисков
30. Карта финансовых рисков организации и подходы к ее построению
31. Качественные методы оценки финансовых рисков
32. Количественные методы оценки финансовых рисков
33. Математико-статистические методы оценки финансовых рисков
34. Основное содержание концепции рисковой стоимости (VAR).
35. Оценка вероятности дефолта с использованием модели Альтмана
36. Концепция рентабельности капитала с учетом риска.
37. Классификация финансовых рисков банков в соответствии с требованиями Банка России и Базельского комитета по банковскому надзору.
38. Понятие кредитного рейтинга. Международные кредитные рейтинги и их оценка.

39. Управление активами и пассивами организаций
40. Диверсификация как метод управления финансовыми рисками
41. Портфельный подход к управлению финансовыми рисками
42. Лимитирование как инструмент управления финансовыми рисками
43. Риск-аппетит в управлении финансовыми рисками
44. Хеджирование: понятие, механизм, виды используемых финансовых инструментов
45. Производные финансовые инструменты
46. Понятие и виды секьюритизации
47. Понятие денежных потоков и их классификация в зависимости от уровня финансового риска
48. Страхование как инструмент управления финансовыми рисками: понятие, сфера применения, механизм воздействия на финансовые риски, ограничения в использовании.
49. Страхование кредитных рисков
50. Гарантийное страхование и его применение в управлении кредитными рисками
51. Страхование депозитных вкладов в Российской Федерации
52. Страхование предпринимательских и финансовых рисков в Российской Федерации
53. Самострахование как инструмент управления финансовыми рисками, область применения, преимущества и недостатки
54. Кэптивное страхование и его роль в управлении финансовыми рисками
55. Финансовые риски нефинансовой организации
56. Управление кредитным риском предприятия
57. Особенности финансовых рисков банка
58. Требования Банка России по управлению финансовыми рисками кредитной организации.
59. Резервирование как инструмент управления финансовыми рисками банка
60. Источники финансовых рисков страховых организаций
61. Перестрахование как инструмент управления финансовыми рисками страховых организаций
62. Нормативные требования к финансовой устойчивости страховщиков
63. Финансовые риски профессиональных участников рынка ценных бумаг в РФ.
64. Система финансового риск-менеджмента профессиональных участников рынка ценных бумаг
65. Управление финансовыми рисками инвестиционных проектов
66. Финансовые риски государства и их классификация
67. Управление финансовыми рисками государства
68. Экономическая сущность финансового кризиса
69. Анализ волатильности доходов.
70. Страновой риск и методы его оценки