

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное учреждение
высшего профессионального образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Центр магистратуры



УТВЕРЖДАЮ

Проректор по образовательной деятельности КФУ

Проф. Татарский Да



20__ г.

подписано электронно-цифровой подписью

Программа дисциплины

Анализ и управление финансовыми рисками Б1.В.ОД.5

Направление подготовки: 38.04.01 - Экономика

Профиль подготовки: Финансовая аналитика

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: заочное

Язык обучения: русский

Автор(ы):

Пыркова Г.Х.

Рецензент(ы):

Кох И.А.

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий(ая) кафедрой: Кох И. А.

Протокол заседания кафедры № ____ от "____" 201__ г

Учебно-методическая комиссия Института управления, экономики и финансов (центр магистратуры):

Протокол заседания УМК № ____ от "____" 201__ г

Регистрационный № 957911218

Казань

2018

Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. Пыркова Г.Х. кафедра ценных бумаг, биржевого дела и страхования Институту управления, экономики и финансов , guzel831@mail.ru

1. Цели освоения дисциплины

Изучение дисциплины ставит целью формирование у студентов теоретических знаний и практических навыков в области оценки и управления финансовыми рисками. Полученные знания дадут возможность, с одной стороны, научиться определять и оценивать финансовые риски, а с другой - эффективно и рационально осуществлять управление ими.

Цель - дать студентам четкое представление об особенностях операций коммерческих банков, проводимых на рынке ценных бумаг, которые отражены в федеральных законах, решениях правительства, законодательных актах, нормативных документах Банка России.

Задачами дисциплины являются:

- изучение подходов к определению риска и способов классификации риска;
- выявление причин возникновения каждого вида рисков;
- ознакомление студентов с методами анализа и оценки финансовых рисков;
- освоение стратегических и тактических приемов управления различными видами рисков, а также возможности их сочетания;
- обучение практическому использованию методов снижения степени финансовых рисков;
- формирование навыков аналитической деятельности при принятии стратегических решений по управлению финансовыми рисками.

2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б1.В.ОД.5 Дисциплины (модули)" основной образовательной программы 38.04.01 Экономика и относится к обязательным дисциплинам. Осваивается на 2 курсе, 3 семестр.

Данная учебная дисциплина включена в раздел Б3.В12 вариативной части профессионального цикла дисциплин. Осваивается на четвертом курсе (7 семестр) для студентов дневного отделения с нормативным сроком обучения и на базе СПО.

Изучению дисциплины 'Управление финансовыми рисками' предшествует освоение следующих дисциплин: 'Финансовые рынки', 'Страхование', 'Инвестиции'.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-2 (профессиональные компетенции)	способность на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов
ПК-21 (профессиональные компетенции)	способность составлять финансовые планы организаций, обеспечивать осуществление финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления
ПК-3 (профессиональные компетенции)	способность выполнять необходимые для составления экономических разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-4 (профессиональные компетенции)	способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты
ПК-8 (профессиональные компетенции)	способность использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

В результате овладения программой бакалавры должны:

Знать:

- экономическую сущность риска и основные виды риска;
- методы оценки рисков и убытков;
- методы управления рисками и их возможные сочетания;
- методики принятия управленческих решений в условиях риска;
- особенности управления различными видами финансового риска

2. должен уметь:

В результате овладения программой бакалавры должны:

Уметь:

- осуществлять качественный анализ финансовых рисков;
- использовать эффективные методы оценки финансовых рисков;
- определять степень подверженности финансовым рискам;
- осуществлять управление финансовыми рисками;
- прогнозировать риски финансовых операций;
- определять эффективные стратегии управления с учетом риска;
- выбирать и применять эффективные мероприятия, направленные на снижение финансовых рисков.

3. должен владеть:

В результате овладения программой бакалавры должны:

Владеть:

- навыками оценки величины риска и возможного ущерба;
- приемами и навыками создания, мониторинга и корректировки программы управления рисками;
- практическими навыками, позволяющими профессионально принимать управленческие решения в условиях риска.

4. должен демонстрировать способность и готовность:

Демонстрировать способность и готовность:

- оперировать широким кругом знаний в области изучения различных видов финансовых рисков;
- использовать в практической деятельности, полученные теоретические знания;
- применять аналитический подход к определению проблем в области управления финансовыми рисками и нахождению способов их решения.

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачетных(ые) единиц(ы) 180 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины экзамен в 3 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Понятие и классификация финансовых рисков	3	1,2	1	4	0	Дискуссия
2.	Тема 2. Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы	3	3,4	2	4	0	Устный опрос
3.	Тема 3. Управление банковскими рисками	3	5	1	2	0	Контрольная работа
4.	Тема 4. Управление кредитным риском	3	6,7	1	4	0	Контрольная работа
5.	Тема 5. Риск ликвидности: методы оценки и управления	3	8,9	1	4	0	Контрольная работа
6.	Тема 6. Управление процентным риском	3	10	1	2	0	Контрольная работа
7.	Тема 7. Управление валютным риском	3	11	1	2	0	Контрольная работа
8.	Тема 8. Управление операционными рисками	3	12	1	2	0	Письменная работа
9.	Тема 9. Управление рыночными рисками	3	13	1	4	0	Письменная работа
.	Тема . Итоговая форма контроля	3		0	0	0	Экзамен
	Итого			10	28	0	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Понятие и классификация финансовых рисков

лекционное занятие (1 часа(ов)):

1.Понятие риска. Формы проявления риска. Природа риска. 2.Классификация рисков по различным признакам. 3.Квалификационная система рисков. 4.Направления деятельности компаний, при реализации которых возникают риски.

практическое занятие (4 часа(ов)):

1.Риски, обусловленные вероятностью, и риски, обусловленные неопределенностью.

2.Определение субъектов, для которых возникает финансовый риск в процессе осуществления различных видов деятельности. 3.Предпринимательские и непредпринимательские риски. 4.Чистые и спекулятивные риски. 5.Коммерческие и финансовые риски. 6.Риски, связанные с покупательной способностью денег и инвестиционные риски. 7.Систематические и несистематические риски.

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

лекционное занятие (2 часа(ов)):

1.Современная теория финансового риск-менеджмента: предпосылки возникновения и основные этапы развития. 2.Задачи и роль управления финансовыми рисками в деятельности компаний. 3.Основные этапы процесса управления рисками. 4.Задачи и принципы составления программы управления рисками. 5.Основные методы управления рисками.

практическое занятие (4 часа(ов)):

1.Предпосылки возникновения и основные этапы развития. 2.Мотивация интереса к риск-менеджменту. 3.Основные характеристики финансового риск-менеджмента. 4.Убыток (ущерб) и его виды. Классы убытков. Максимально возможный и максимально вероятный риск. 5.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. 6.Правило выбора стратегических методов управления рисками.

Тема 3. . Управление банковскими рисками

лекционное занятие (1 часа(ов)):

1.Классификация рисков банковской деятельности. 2.Особенности методов управления банковскими рисками. 3.Требования и нормативы ЦБ РФ и их влияние на риски деятельности коммерческих банков.

практическое занятие (2 часа(ов)):

1.Классификация рисков банковской деятельности. Внешние и внутренние риски. Риски пассивных и активных операций. 2.Дискуссионные вопросы содержания рыночного риска банковской деятельности. 3.Особенности методов управления банковскими рисками. 4.Влияние на практике требований и нормативов ЦБ РФ на риски деятельности коммерческих банков.

Тема 4. Управление кредитным риском

лекционное занятие (1 часа(ов)):

1.Понятие кредитного риска и его особенности. 2.Тактические методы управления кредитным риском. Гарантии правительства или банка. Страхование международных кредитов. 3.Оценка кредитоспособности заемщика и эмитента как способ снижения кредитного риска.

4.Кредитные деривативы как способ управления кредитным риском. 5.Факторинговое обслуживание.

практическое занятие (4 часа(ов)):

1. Дискуссионные вопросы о структуре кредитного риска. 2.Оценка кредитного риска. 3. Система оценочных коэффициентов. Фундаментальный анализ эмитента и его бумаг.

4.Формирование резерва на возможные потери по ссудам. 5.Кредитные деривативы как способ управления кредитным риском. 6.Понятие и виды кредитных деривативов. Форварды, свопы, опционы, индексные инструменты как представители семейства кредитных деривативов. 7.Факторинговое обслуживание.

Тема 5. Риск ликвидности: методы оценки и управления

лекционное занятие (1 часа(ов)):

1.Основные характеристики риска ликвидности. 2.Источники риска ликвидности фондирования (балансовой ликвидности). 3.Основные мероприятия по управлению риском ликвидности фондирования.

практическое занятие (4 часа(ов)):

1. Источники возникновения риска ликвидности. 2.Количественная оценка рыночной ликвидности. 3.Динамика рыночной ликвидности. 4.Факторы рыночной ликвидности. 5.Источники риска ликвидности фондирования (балансовой ликвидности). 6.Основные мероприятия по управлению риском ликвидности фондирования.

Тема 6. Управление процентным риском

лекционное занятие (1 часа(ов)):

1.Понятие процентного риска и сфера его возникновения. 2.Виды процентного риска: риск потерь от изменения потоков денежных средств, портфельный риск и экономический риск. 3.Измерение процентного риска. Факторы, влияющие на процентный риск. 4.Основные методы управления процентным риском и приемы их реализации.

практическое занятие (2 часа(ов)):

1.Источники возникновения процентного риска. 2.Риск потерь от изменения потоков денежных средств, 3.Портфельный риск и экономический риск. 4.Измерение процентного риска. 5.Факторы, влияющие на процентный риск. 6.Метод длительности, нейтрализация требований и обязательств 7.Метод эффективной границы. 8.Пассивные стратегии управления портфелем ценных бумаг 9.Хеджирование.

Тема 7. Управление валютным риском

лекционное занятие (1 часа(ов)):

1.Понятие валютного риска и его виды. 2.Особенности управления трансляционным валютным риском. 3.Защитные оговорки как метод страхования валютных рисков. Виды защитных оговорок. 4.Виды валютных корзин. 5.Компенсационные сделки.

практическое занятие (2 часа(ов)):

1.Особенности операционного, трансляционного и экономического валютного риска. 2. Золотая (прямая и косвенная), валютная и многовалютная оговорки. 3.Симметричная, ассиметрическая, стандартная, регулируемая. 4.Элементы механизма действия валютной оговорки. 5.Сочетание понятий компенсация и управление валютными операциями многонациональной компании. 6.Иные методы управления валютными рисками на производственных предприятиях: структурная балансировка, изменение срока платежа, параллельные ссуды, форфейтирование, самострахование, страхование, хеджирование.

Тема 8. Управление операционными рисками

лекционное занятие (1 часа(ов)):

1.Определение операционных рисков. 2.Классификация операционных рисков. 3.Методики выявления и оценки операционных рисков. 4.Управление операционными рисками. 5.Организация использования информационных системных комплексов.

практическое занятие (2 часа(ов)):

1.Потенциальные источники операционных рисков. 2. Расчет основных показателей деятельности компании, 3.Анализ волатильности доходов, распределение вероятностей убытков. 4.Особенности методов управления рисками без сокращения объемов операций и путем лимитирования. 5.Организация использования информационных системных комплексов.

Тема 9. Управление рыночными рисками

лекционное занятие (1 часа(ов)):

1.Виды рыночных рисков. 2.Волатильность и способы ее моделирования. 3.Оценка рисков. 4. Механизмы управления рыночным риском.

практическое занятие (4 часа(ов)):

1.Классификация рыночных рисков по различным признакам. 2.Концепция рисковой стоимости. 3.Дюрация и иммунизация портфеля. 4.VaR (Value-at-Risk) и основные методы его расчета. 5.Методы построения функции финансового результата от изменения факторов риска. 6.Механизмы управления рыночным риском.

4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
1.	Тема 1. Понятие и классификация финансовых рисков	3	1,2	подготовка к дискуссии	14	Дискуссия
2.	Тема 2. Риск-менеджмент: понятие, стратегия и методы	3	3,4	подготовка к устному опросу	14	Устный опрос
3.	Тема 3. Управление банковскими рисками	3	5	подготовка к контрольной работе	15	Контрольная работа
4.	Тема 4. Управление кредитным риском	3	6,7	подготовка к контрольной работе	15	Контрольная работа
5.	Тема 5. Риск ликвидности: методы оценки и управления	3	8,9	Подготовка к контрольной работе	15	Контрольная работа
6.	Тема 6. Управление процентным риском	3	10	подготовка к контрольной работе	15	Контрольная работа
7.	Тема 7. Управление валютным риском	3	11	подготовка к контрольной работе	15	Контрольная работа
8.	Тема 8. Управление операционными рисками	3	12	подготовка к письменной работе	15	Письменная работа
9.	Тема 9. Управление рыночными рисками	3	13	подготовка к письменной работе	15	Письменная работа
Итого					133	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

Освоение дисциплины 'Управление финансовыми рисками' предполагает использование как традиционных (лекции, практические занятия с использованием методических материалов), так и инновационных образовательных технологий с использованием в учебном процессе интерактивных форм проведения занятий: учебные групповые дискуссии, презентации докладов.

6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Тема 1. Понятие и классификация финансовых рисков

Дискуссия , примерные вопросы:

Понятие риска и его особенности как экономической категории 2. Уровни субъектов, для которых возникает экономический риск 3. Взаимосвязь категорий риск и доходность 4. Взаимосвязь понятий "риск" и "убытки" 5. Природа риска, обусловленная вероятностью, и риска, обусловленная неопределенностью. 6. Классификация рисков в зависимости от возможного результата, от основной причины возникновения

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

Устный опрос , примерные вопросы:

Суть метода избежания убытков 17. Суть метода принятия рисков на себя 18. Суть метода предотвращения убытков 19. Суть метода уменьшения размера убытков 20. Суть метода страхования 21. Суть метода самострахования 22. Суть метода хеджирования 23. Методы передачи риска и их содержание

Тема 3. . Управление банковскими рисками

Контрольная работа , примерные вопросы:

Критерии измерения величины (степени) риска 29. Классификация рисков банковской деятельности 30. Особенности методов управления банковскими рисками

Тема 4. Управление кредитным риском

Контрольная работа , примерные вопросы:

Понятие кредитного риска и сфера его возникновения 39. Основные способы защиты от кредитных рисков 40. Порядок формирования и использования резерва на возможные потери по ссудам в коммерческом банке

Тема 5. Риск ликвидности: методы оценки и управления

Контрольная работа , примерные вопросы:

1. В чем заключаются основные характеристики риска ликвидности? 2. Какова количественная оценка рыночной ликвидности? 3. Какие выделяют факторы рыночной ликвидности? 4. Что является источниками риска ликвидности фондирования (балансовой ликвидности)? 5. Какие проводят основные мероприятия по управлению риском ликвидности фондирования?

Тема 6. Управление процентным риском

Контрольная работа , примерные вопросы:

Понятие и виды процентного риска. Сфера его возникновения 45. Особенности управления процентным риском в коммерческом банке 46. Понятие хеджирования 47. Сущность и виды форвардных контрактов 48. Понятие и виды фьючерсных контрактов

Тема 7. Управление валютным риском

Контрольная работа , примерные вопросы:

Понятие и виды валютного риска 32. Управление трансляционным валютным риском 33. Защитные оговорки как метод управления валютным риском. Виды валютных оговорок 34. Преимущества многовалютной оговорки по сравнению с одновалютной оговоркой 35. Виды валютных корзин (валютных "коктейлей")

Тема 8. Управление операционными рисками

Письменная работа , примерные вопросы:

Методы передачи риска и их содержание 24. Пересмотр программ управления рисками 25. Основные подходы к оценке риска 26. Метод построения дерева вероятностей 27. Исходная, условная и совместная вероятности. Методы их подсчета 28. Критерии измерения величины (степени) риска

Тема 9. Управление рыночными рисками

Письменная работа , примерные вопросы:

Понятие хеджирования 47. Сущность и виды форвардных контрактов 48. Понятие и виды фьючерсных контрактов 49. Особенности опционных контрактов и их классификация 50. Виды хеджирования и техника проведения операций с различными инструментами

Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к экзамену:

Вопросы к зачету

1. Понятие риска и его особенности как экономической категории
2. Уровни субъектов, для которых возникает экономический риск
3. Взаимосвязь категорий риск и доходность
4. Взаимосвязь понятий "риск" и "убытки"
5. Природа риска, обусловленная вероятностью, и риска, обусловленная неопределенностью.
6. Классификация рисков в зависимости от возможного результата, от основной причины возникновения
7. Квалификационная система рисков
8. Краткая характеристика финансовых рисков
9. Риски, возникающие при осуществлении таможенной деятельности
10. Риски, возникающие при проведении экспортно-импортных операций
11. Краткая характеристика коммерческих рисков
12. Сущность процесса управления рисками
13. Этапы управления рисками. Функции риск-менеджера на каждом этапе
14. Направления деятельности компании, при осуществлении которых возникают риски
15. Максимально возможный и максимально вероятный риск. Значение их оценки
16. Суть метода избежания убытков
17. Суть метода принятия рисков на себя
18. Суть метода предотвращения убытков
19. Суть метода уменьшения размера убытков
20. Суть метода страхования
21. Суть метода самострахования
22. Суть метода хеджирования
23. Методы передачи риска и их содержание
24. Пересмотр программ управления рисками
25. Основные подходы к оценке риска
26. Метод построения дерева вероятностей
27. Исходная, условная и совместная вероятности. Методы их подсчета
28. Критерии измерения величины (степени) риска
29. Классификация рисков банковской деятельности
30. Особенности методов управления банковскими рисками
31. Понятие и виды валютного риска
32. Управление трансляционным валютным риском
33. Защитные оговорки как метод управления валютным риском. Виды валютных оговорок
34. Преимущества многовалютной оговорки по сравнению с одновалютной оговоркой
35. Виды валютных корзин (валютных "коктейлей")
36. Суть методики "компенсация"
37. "Подушки" способ устранения валютного риска. Риски, возникающие при использовании "подушки"
38. Понятие кредитного риска и сфера его возникновения
39. Основные способы защиты от кредитных рисков
40. Порядок формирования и использования резерва на возможные потери по ссудам в коммерческом банке
41. Принципы ликвидности и рычаги воздействия со стороны государственных органов по их обязательному соблюдению
42. Основные характеристики риска ликвидности

43. Кредитные деривативы: понятие, виды и их использование для управления кредитным риском
44. Понятие и виды процентного риска. Сфера его возникновения
45. Особенности управления процентным риском в коммерческом банке
46. Понятие хеджирования
47. Сущность и виды форвардных контрактов
48. Понятие и виды фьючерсных контрактов
49. Особенности опционных контрактов и их классификация
50. Виды хеджирования и техника проведения операций с различными инструментами
51. Особенности хеджирования валютного риска. Используемые инструменты
52. Особенности хеджирования процентного риска. Используемые инструменты
53. Свопы как инструменты передачи риска

7.1. Основная литература:

1. Антонов Г.Д. Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. ? М. : ИНФРА-М, 2017. ? 153 с. ? (Высшее образование: Бакалавриат). ? [www.dx.doi.org/10.12737/6216](http://dx.doi.org/10.12737/6216).<http://znanium.com/bookread2.php?book=908034>
2. Воробьев, С. Н. Управление рисками в предпринимательстве [Электронный ресурс] / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - 4-е изд., испр. - М. : Издательско-торговая корпорация 'Дашков и Ко', 2013. - 482 с. - ISBN 978-5-394-01987-6.<http://znanium.com/bookread2.php?book=430664>
3. Иванов, А. П. Финансовые инвестиции на рынке ценных бумаг [Электронный ресурс] / А. П. Иванов. ? 5-е изд., перераб. и доп. - М. : Издательско-торговая корпорация 'Дашков и Ко', 2012. - 480 с. - ISBN 978-5-394-01750-6.<http://znanium.com/bookread2.php?book=430524>
4. Рудько-Силиванов, В. В. Управление банковскими рисками в условиях глобализации мировой экономики [Электронный ресурс] : Науч.-практ. пособие для специалистов / В. В. Рудько-Силиванов, Н .В. Зубрилова, К. В. Лапина, Н. В. Кучина; под ред. В. В. Ткаченко. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : РИОР : ИНФРА-М, 2012. - 318 с. - (Научная мысль). - ISBN 978-5-369-01120-1 (РИОР), ISBN 978-5-16-006292-1 (ИНФРА-М).<http://znanium.com/bookread2.php?book=415471>
5. Управление финансовыми рисками/Под ред. Макарова С.Н., Ферова И.С., Янкина И.А.. - Краснояр.: СФУ, 2014. - 230 с.: ISBN 978-5-7638-3139-9.<http://znanium.com/bookread2.php?book=549466>

7.2. Дополнительная литература:

1. Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс] : учебное пособие / К. В. Балдин. - 2-е изд. - М.: Дашков и К, 2012. - 420 с. - ISBN 978-5-394-01459-8.<http://znanium.com/bookread2.php?book=415224>
2. Грачева М.В. Риск-менеджмент инвестиционного проекта [Электронный ресурс]: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина. - М.: ЮНИТИДАНА, 2012. - 544 с. - ISBN 978-5-238-01506-4..<http://znanium.com/bookread2.php?book=391215>
3. Каячев, Г. Ф. Финансовые рынки и институты [Электронный ресурс] : Учеб. пособие / Г. Ф. Каячев, Л. В. Каячева, С. В. Кропачев, М. Н. Черных. - Красноярск: Сибирский федеральный ун-т, 2011. - 240 с. - ISBN 978-5-7638-2155-0.<http://znanium.com/bookread2.php?book=443146>
4. Янкина И.А. Финансовой устойчивостью и рисками коммерческого банка [Электронный ресурс] : монография / И. А. Янкина, Е. В. Покидышева. - Красноярск. - Сиб. федер. ун-т., 2012. - 88 с. - ISBN 978-5-7638-2588-6.<http://znanium.com/bookread2.php?book=492891>

7.3. Интернет-ресурсы:

Официальный портал информационного агентства ФИНАМ. Подробная аналитика по рынку ценных бумаг - <http://www.pmonline.ru>

Официальный портал информационного агентства РОСБИЗНЕСКОНСАЛТИНГ. Подробная аналитика по рынку ценных бумаг - www.rbc.ru

Официальный портал Министерства финансов РФ - www.mfinfin.ru

Официальный портал Росстата - www.gks.ru

Официальный портал Центрального Банка РФ - <http://www.cbr.ru>

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Анализ и управление финансовыми рисками" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Мультимедийная аудитория, вместимостью более 60 человек. Мультимедийная аудитория состоит из интегрированных инженерных систем с единой системой управления, оснащенная современными средствами воспроизведения и визуализации любой видео и аудио информации, получения и передачи электронных документов. Типовая комплектация мультимедийной аудитории состоит из: мультимедийного проектора, автоматизированного проекционного экрана, акустической системы, а также интерактивной трибуны преподавателя, включающей тач-скрин монитор с диагональю не менее 22 дюймов, персональный компьютер (с техническими характеристиками не ниже Intel Core i3-2100, DDR3 4096Mb, 500Gb), конференц-микрофон, беспроводной микрофон, блок управления оборудованием, интерфейсы подключения: USB, audio, HDMI. Интерактивная трибуна преподавателя является ключевым элементом управления, объединяющим все устройства в единую систему, и служит полноценным рабочим местом преподавателя. Преподаватель имеет возможность легко управлять всей системой, не отходя от трибуны, что позволяет проводить лекции, практические занятия, презентации, вебинары, конференции и другие виды аудиторной нагрузки обучающихся в удобной и доступной для них форме с применением современных интерактивных средств обучения, в том числе с использованием в процессе обучения всех корпоративных ресурсов. Мультимедийная аудитория также оснащена широкополосным доступом в сеть интернет. Компьютерное оборудование имеет соответствующее лицензионное программное обеспечение.

Компьютерный класс, представляющий собой рабочее место преподавателя и не менее 15 рабочих мест студентов, включающих компьютерный стол, стул, персональный компьютер, лицензионное программное обеспечение. Каждый компьютер имеет широкополосный доступ в сеть Интернет. Все компьютеры подключены к корпоративной компьютерной сети КФУ и находятся в едином домене.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе "БиблиоРоссика", доступ к которой предоставлен студентам. В ЭБС "БиблиоРоссика" представлены коллекции актуальной научной и учебной литературы по гуманитарным наукам, включающие в себя публикации ведущих российских издательств гуманитарной литературы, издания на английском языке ведущих американских и европейских издательств, а также редкие и малотиражные издания российских региональных вузов. ЭБС "БиблиоРоссика" обеспечивает широкий законный доступ к необходимым для образовательного процесса изданиям с использованием инновационных технологий и соответствует всем требованиям федеральных государственных образовательных стандартов высшего профессионального образования (ФГОС ВПО) нового поколения.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе "ZNANIUM.COM", доступ к которой предоставлен студентам. ЭБС "ZNANIUM.COM" содержит произведения крупнейших российских учёных, руководителей государственных органов, преподавателей ведущих вузов страны, высококвалифицированных специалистов в различных сферах бизнеса. Фонд библиотеки сформирован с учетом всех изменений образовательных стандартов и включает учебники, учебные пособия, УМК, монографии, авторефераты, диссертации, энциклопедии, словари и справочники, законодательно-нормативные документы, специальные периодические издания и издания, выпускаемые издательствами вузов. В настоящее время ЭБС ZNANIUM.COM соответствует всем требованиям федеральных государственных образовательных стандартов высшего профессионального образования (ФГОС ВПО) нового поколения.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе Издательства "Лань", доступ к которой предоставлен студентам. ЭБС Издательства "Лань" включает в себя электронные версии книг издательства "Лань" и других ведущих издательств учебной литературы, а также электронные версии периодических изданий по естественным, техническим и гуманитарным наукам. ЭБС Издательства "Лань" обеспечивает доступ к научной, учебной литературе и научным периодическим изданиям по максимальному количеству профильных направлений с соблюдением всех авторских и смежных прав.

1. Компьютерные классы с выходом в сеть Интернет.
2. Аудитории, оборудованные мультимедийными средствами обучения.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 38.04.01 "Экономика" и магистерской программе Финансовая аналитика .

Автор(ы):

Пыркова Г.Х. _____
"___" 201 ___ г.

Рецензент(ы):

Кох И.А. _____
"___" 201 ___ г.