

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Институт управления, экономики и финансов
Центр магистратуры



УТВЕРЖДАЮ

Проректор по образовательной деятельности КФУ

Проф. Д.А. Таюрский



» _____ 20__ г.

подписано электронно-цифровой подписью

Программа дисциплины

Управление финансовыми рисками (продвинутый курс)

Направление подготовки: 38.04.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Финансовый менеджмент

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2018

Содержание

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения ОПОП ВО
2. Место дисциплины (модуля) в структуре ОПОП ВО
3. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся
4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий
 - 4.1. Структура и тематический план контактной и самостоятельной работы по дисциплине (модулю)
 - 4.2. Содержание дисциплины (модуля)
5. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)
6. Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю)
7. Перечень литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)
8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины (модуля)
9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)
10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)
11. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)
12. Средства адаптации преподавания дисциплины (модуля) к потребностям обучающихся инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья
13. Приложение №1. Фонд оценочных средств
14. Приложение №2. Перечень литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)
15. Приложение №3. Перечень информационных технологий, используемых для освоения дисциплины (модуля), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. (доцент) Филиппова И.А. (кафедра управления корпоративными финансами, Институт управления, экономики и финансов), IAFilippova@kpfu.ru

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения ОПОП ВО

Обучающийся, освоивший дисциплину (модуль), должен обладать следующими компетенциями:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-3	способностью использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач
ПК-4	способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения

Обучающийся, освоивший дисциплину (модуль):

Должен знать:

- основные понятия, категории и инструменты управления финансовыми рисками организации;
- основы построения показателей, характеризующих уровень финансовых рисков;
- содержание, цели и задачи организации риск-менеджмента;
- сущность и состав финансовых рисков организации;
- методы качественной и количественной оценки рисков;
- методы управления рисками.

Должен уметь:

- рассчитывать на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы показатели, характеризующие уровень финансовых рисков организации;
- использовать источники экономической, социальной, управленческой информации для оценки уровня финансовых рисков организации;
- осуществлять поиск информации по полученному заданию с целью воздействия на уровень финансовых рисков организации;
- осуществлять сбор и анализ данных, необходимых для решения задач управления финансовыми рисками организации;
- осуществлять выбор инструментальных средств для моделирования, оценки и анализа рисков ситуации;
- анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы.

Должен владеть:

- базовой терминологией современного риск-менеджмента, включая общепринятые употребляемые аббревиатуры;
- методами сбора, обработки и анализа информации, необходимой для оценки уровня финансовых рисков организации;
- практическими навыками в области осуществления финансовых расчетов, выполнения финансового моделирования, финансового анализа с целью оценки финансовых рисков.

Должен демонстрировать способность и готовность:

- оперировать базовыми терминами и знаниями в области риск-менеджмента;
- осуществлять обработку и анализ информации, характеризующей уровень финансовых рисков и возможные угрозы;
- использовать возможности программных инструментальных средств для решения задач управления финансовыми рисками;
- критически анализировать полученные результаты обработки информации об уровне риска и обосновывать управленческие решения с учетом оценки рисков.

2. Место дисциплины (модуля) в структуре ОПОП ВО

Данная дисциплина (модуль) включена в раздел "Б1.В.ОД.8 Дисциплины (модули)" основной профессиональной образовательной программы 38.04.02 "Менеджмент (Финансовый менеджмент)" и относится к обязательным дисциплинам.

Осваивается на 2 курсе в 3 семестре.

3. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных(ые) единиц(ы) на 144 часа(ов).

Контактная работа - 48 часа(ов), в том числе лекции - 12 часа(ов), практические занятия - 36 часа(ов), лабораторные работы - 0 часа(ов), контроль самостоятельной работы - 0 часа(ов).

Самостоятельная работа - 60 часа(ов).

Контроль (зачёт / экзамен) - 36 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины: экзамен в 3 семестре.

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

4.1 Структура и тематический план контактной и самостоятельной работы по дисциплине (модулю)

N	Разделы дисциплины / модуля	Семестр	Виды и часы контактной работы, их трудоемкость (в часах)			Самостоятельная работа
			Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Риск-менеджмент в корпорации	3	1	4	0	6
2.	Тема 2. Методы исследования и анализа рисков	3	1	4	0	6
3.	Тема 3. Выбор рациональной стратегии в условиях неопределенности и рисков	3	1	4	0	6
4.	Тема 4. Портфельный подход Марковица к оценке общего риска фондового портфеля	3	2	4	0	6
5.	Тема 5. Модель CAPM (Capital Asset Pricing Model) и ее использование при анализе альтернативы "риск-доходность "	3	1	4	0	6
6.	Тема 6. Факторный анализ и применение арбитражной теории Росса в оценке рисков	3	2	2	0	6
7.	Тема 7. Риски угрозы банкротства или дефолта корпорации	3	1	4	0	6
8.	Тема 8. Риски инвестиционной деятельности корпораций	3	1	4	0	6
9.	Тема 9. Рыночные риски корпораций и методика их комплексной оценки VAR(Value at risk)	3	1	2	0	6
10.	Тема 10. Хеджирование рисков корпораций при помощи производных финансовых инструментов	3	1	4	0	6
	Итого		12	36	0	60

4.2 Содержание дисциплины (модуля)

Тема 1. Риск-менеджмент в корпорации

Вопросы темы:

1. Развитие концепции управления рисками в зарубежной и отечественной экономической науке и практике.

2. Сущность, цель, задачи, принципы, внешние и внутренние ограничения системы управления рисками компании.
3. Системный подход к управлению рисками и основные этапы процесса управления рисками.
4. Содержание основных приемов воздействия на финансовые риски корпораций.
5. Характеристика информации, необходимой для управления рисками и примеры ее использования в риск-менеджменте.
6. Источники финансирования мероприятий по управлению рисками.
7. Службы риск-менеджмента в корпорации. Цель, задачи, обязанности, полномочия риск-менеджеров.
8. Анализ правового обеспечения по управлению рисками.
9. Этапы эволюции риск-менеджмента и современные концепции развития риск-менеджмента.

Тема 2. Методы исследования и анализа рисков

Вопросы темы:

1. Содержание различных методов выявления рисков: опросные листы, структурные диаграммы, карты потоков, инспекции, анализ финансовой и управленческой отчетности.
2. Качественный и количественный анализ рисков. Меры риска: стандартное отклонение, дисперсия, коэффициент вариации доходности.
3. Сущность статистического подхода к количественной оценке риска финансового актива.
4. Сущность вероятностного подхода к количественной оценке риска финансового актива.
5. Зональный метод оценки рисков и эмпирическая шкала уровня рисков: область допустимого, критического, катастрофического рисков.
6. Применение деревьев решений в риск-менеджменте.
7. Экспертные методы оценки рисков.

Тема 3. Выбор рациональной стратегии в условиях неопределенности и рисков

Вопросы темы:

1. Теория игр, матричные игры, игры с природой.
2. Содержание матрицы эффективности, матрицы затрат, матрицы упущенной выгоды.
3. Сущность критериев: гарантированного результата Вальда, пессимизма, оптимизма, минимаксного риска Сэвиджа, обобщенного максимина Гурвица. Выбор рациональной стратегии в условиях неопределенности на базе критериев: Вальда, оптимизма, пессимизма, Сэвиджа, Гурвица.
4. Методика выбора рациональной стратегии в условиях риска: расчет и анализ средневзвешенной ожидаемой доходности и уровня риска по каждой стратегии.

Тема 4. Портфельный подход Марковица к оценке общего риска фондового портфеля

Вопросы темы:

1. Количественная оценка ожидаемой доходности фондового портфеля.
2. Состав и сущность ограничений, лежащих в основе портфельной теории Марковица.
3. Особенности портфеля Марковица.
4. Основные выводы по портфельной теории Марковица.
5. Суть стратегии диверсификации портфеля по Марковицу и ее отличие от "наивной диверсификации".
6. Допустимый и эффективный портфель рискованных активов по Марковицу. Оптимизационный подход к формированию вариантов фондового портфеля с учетом теории Марковица.

Тема 5. Модель CAPM (Capital Asset Pricing Model) и ее использование при анализе альтернативы "риск-доходность"

Вопросы темы:

1. Рыночный риск, концепция рыночного равновесия. Интерпретация уравнения эффективной линии рынка.
2. Оценка ожидаемой доходности финансового актива по модели CAPM с учетом рыночного (системного) риска. Понятие рыночного портфеля. Понятие премии за риск.
3. Особенности портфеля Шарпа и количественная оценка системного риска фондового портфеля с помощью "беты".
4. Оптимизационный подход к формированию фондового портфеля с учетом системного риска.

Тема 6. Факторный анализ и применение арбитражной теории Росса в оценке рисков

Вопросы темы:

1. Технология проведения факторного анализа при обосновании финансовых решений с применением факторных моделей. Свойства факторных моделей. Модель Росса ценообразования финансовых активов с учетом факторного риска.

2. Назначение и примеры построения однофакторных и многофакторных моделей при обосновании финансовых решений по составу и структуре фондового портфеля.
3. Понятие, сущность и возможность арбитража и арбитражного портфеля. Условия, выполняемые при формировании арбитражного портфеля.
4. Примеры формирования арбитражных портфелей с применением оптимизационных моделей.

Тема 7. Риски угрозы банкротства или дефолта корпорации

Вопросы по теме:

1. Понятие кредитных рисков и рисков банкротства (дефолта) компании. Факторы, определяющие их уровень.
2. Систематизация моделей диагностики или прогнозирования вероятности банкротства компании.
3. Анализ вероятности дефолта при помощи дискриминантных моделей зарубежных авторов.
4. Определение вероятности банкротства при помощи дискриминантных моделей отечественных авторов.
5. Модели рейтингового финансового анализа для оценки уровня рисков банкротства компании.
6. Применение классификационных моделей для оценки вероятности дефолта корпорации.

Тема 8. Риски инвестиционной деятельности корпораций

Вопросы по теме:

1. Сущность и систематизация рисков инвестиционной деятельности организации.
2. Анализ существующих подходов к управлению инвестиционными рисками в организации.
3. Методы оценки и учета рисков в инвестиционной деятельности.
4. Инструменты снижения рисков инвестиционной деятельности.
5. Сущность и содержание рисков инвестиционного проекта, методы их оценки, инструменты снижения.
6. Применение анализа чувствительности в инвестиционном риск-менеджменте.
7. Метод имитационного стохастического моделирования Монте-Карло как инструмент анализа устойчивости инвестиционного проекта к различным факторам риска.

Тема 9. Рыночные риски корпораций и методика их комплексной оценки VAR(Value at risk)

Вопросы по теме:

1. Систематизация и сущность рыночных рисков корпораций.
2. Понятие, виды и факторы процентного риска. Методические подходы к оценке степени процентного риска. Мероприятия по снижению процентного риска.
3. Валютные риски - сущность, состав и факторы валютных рисков. Методы оценки и снижения валютных рисков.
4. Фондовый риск - сущность, факторы и методы оценки. Методы снижения фондовых рисков.
5. Использование показателя VAR (Value at risk) как интегрированной оценки максимально возможного ущерба в следствие рыночных рисков. Методы оценки рыночных рисков финансовых активов и портфеля с использованием абсолютного VAR.
6. Понятие и учет значения относительного VAR портфеля.

Тема 10. Хеджирование рисков корпораций при помощи производных финансовых инструментов

Вопросы по теме:

1. Производные финансовые инструменты на основе контрактов, их разновидности. Предприятия реального сектора экономики РФ на рынке производных инструментов: цели и задачи операций с деривативами.
2. Хеджирование финансовых рисков при помощи форвардных, фьючерсных контрактов и опционных контрактов.
3. Использование теории опционов для оценки рисковых инвестиций. Анализ рисков, связанных с использованием производных финансовых инструментов.
4. Использование опционных контрактов с целью снижения рисков.

5. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

Самостоятельная работа обучающихся выполняется по заданию и при методическом руководстве преподавателя, но без его непосредственного участия. Самостоятельная работа подразделяется на самостоятельную работу на аудиторных занятиях и на внеаудиторную самостоятельную работу. Самостоятельная работа обучающихся включает как полностью самостоятельное освоение отдельных тем (разделов) дисциплины, так и проработку тем (разделов), осваиваемых во время аудиторной работы. Во время самостоятельной работы обучающиеся читают и конспектируют учебную, научную и справочную литературу, выполняют задания, направленные на закрепление знаний и отработку умений и навыков, готовятся к текущему и промежуточному контролю по дисциплине.

Организация самостоятельной работы обучающихся регламентируется нормативными документами, учебно-методической литературой и электронными образовательными ресурсами, включая:

Порядок организации и осуществления образовательной деятельности по образовательным программам высшего образования - программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры (утвержден приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 5 апреля 2017 года №301)

Письмо Министерства образования Российской Федерации №14-55-996ин/15 от 27 ноября 2002 г. "Об активизации самостоятельной работы студентов высших учебных заведений"

Устав федерального государственного автономного образовательного учреждения "Казанский (Приволжский) федеральный университет"

Правила внутреннего распорядка федерального государственного автономного образовательного учреждения высшего профессионального образования "Казанский (Приволжский) федеральный университет"

Локальные нормативные акты Казанского (Приволжского) федерального университета

ЭБС znanium.com - <http://znanium.com>

6. Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю)

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) включает оценочные материалы, направленные на проверку освоения компетенций, в том числе знаний, умений и навыков. Фонд оценочных средств включает оценочные средства текущего контроля и оценочные средства промежуточной аттестации.

В фонде оценочных средств содержится следующая информация:

- соответствие компетенций планируемому результату обучения по дисциплине (модулю);
- критерии оценивания сформированности компетенций;
- механизм формирования оценки по дисциплине (модулю);
- описание порядка применения и процедуры оценивания для каждого оценочного средства;
- критерии оценивания для каждого оценочного средства;
- содержание оценочных средств, включая требования, предъявляемые к действиям обучающихся, демонстрируемым результатам, задания различных типов.

Фонд оценочных средств по дисциплине находится в Приложении 1 к программе дисциплины (модулю).

7. Перечень литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

Освоение дисциплины (модуля) предполагает изучение основной и дополнительной учебной литературы. Литература может быть доступна обучающимся в одном из двух вариантов (либо в обоих из них):

- в электронном виде - через электронные библиотечные системы на основании заключенных КФУ договоров с правообладателями;
- в печатном виде - в Научной библиотеке им. Н.И. Лобачевского. Обучающиеся получают учебную литературу на абонементе по читательским билетам в соответствии с правилами пользования Научной библиотекой.

Электронные издания доступны дистанционно из любой точки при введении обучающимся своего логина и пароля от личного кабинета в системе "Электронный университет". При использовании печатных изданий библиотечный фонд должен быть укомплектован ими из расчета не менее 0,5 экземпляра (для обучающихся по ФГОС 3++ - не менее 0,25 экземпляра) каждого из изданий основной литературы и не менее 0,25 экземпляра дополнительной литературы на каждого обучающегося из числа лиц, одновременно осваивающих данную дисциплину.

Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля), находится в Приложении 2 к рабочей программе дисциплины. Он подлежит обновлению при изменении условий договоров КФУ с правообладателями электронных изданий и при изменении комплектования фондов Научной библиотеки КФУ.

8. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины (модуля)

Экспертиза рисков - <http://www.riskland.ru>

Аналитическая информация о финансовых рынках - <http://www.k2kapital.com>

Бизнес-ресурсы - http://www.dir.Yahoo.com/Business_and_Economy

Московская межбанковская валютная биржа - <http://www.micex.ru>

Официальный сайт Министерства финансов РФ - <http://www.minfin.ru>

Сайт Центрального банка России - <http://www.cbr.ru>

Финансовая информация - <http://www.mdf.ru>

Финансовые риски - [http:// www. finrisk.ru](http://www.finrisk.ru)

Энциклопедия банковского дела и финансов - <http://www.cofe.ru/Finance>

9. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

В начале каждого семинарского или практического занятия проводится опрос в устной или письменной форме, либо в форме промежуточного тестирования по) для выявления уровня освоения лекционного материала.

По каждой теме учебной дисциплины предусмотрено выполнение самостоятельной работы студентами. Самостоятельная работа, как правило, предполагает работу с лекционным материалом и литературой по теме, указанной в методической разработке по дисциплине в конце каждой темы. В методической разработке по каждой теме сформулированы вопросы для контроля знаний по теме и конкретные задания для самостоятельного выполнения. Темы 3, 4, 5, 7, 11 предполагают выполнение самостоятельных заданий по вариантам из методической разработки и распечатку результатов в среде Ms Excel.

Большая часть практических занятий по дисциплине 'Корпоративные финансовые риски' предполагает использование класса ПК и выполнение практических заданий, указанных в методической разработке, в среде Ms Excel.

10. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости)

Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем, представлен в Приложении 3 к рабочей программе дисциплины (модуля).

11. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Материально-техническое обеспечение образовательного процесса по дисциплине (модулю) включает в себя следующие компоненты:

Помещения для самостоятельной работы обучающихся, укомплектованные специализированной мебелью (столы и стулья) и оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду КФУ.

Учебные аудитории для контактной работы с преподавателем, укомплектованные специализированной мебелью (столы и стулья).

Компьютер и принтер для распечатки раздаточных материалов.

Мультимедийная аудитория.

Компьютерный класс.

12. Средства адаптации преподавания дисциплины к потребностям обучающихся инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья

При необходимости в образовательном процессе применяются следующие методы и технологии, облегчающие восприятие информации обучающимися инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья:

- создание текстовой версии любого нетекстового контента для его возможного преобразования в альтернативные формы, удобные для различных пользователей;
- создание контента, который можно представить в различных видах без потери данных или структуры, предусмотреть возможность масштабирования текста и изображений без потери качества, предусмотреть доступность управления контентом с клавиатуры;
- создание возможностей для обучающихся воспринимать одну и ту же информацию из разных источников - например, так, чтобы лица с нарушениями слуха получали информацию визуально, с нарушениями зрения - аудиально;
- применение программных средств, обеспечивающих возможность освоения навыков и умений, формируемых дисциплиной, за счёт альтернативных способов, в том числе виртуальных лабораторий и симуляционных технологий;
- применение дистанционных образовательных технологий для передачи информации, организации различных форм интерактивной контактной работы обучающегося с преподавателем, в том числе вебинаров, которые могут быть использованы для проведения виртуальных лекций с возможностью взаимодействия всех участников дистанционного обучения, проведения семинаров, выступления с докладами и защиты выполненных работ, проведения тренингов, организации коллективной работы;
- применение дистанционных образовательных технологий для организации форм текущего и промежуточного контроля;
- увеличение продолжительности сдачи обучающимся инвалидом или лицом с ограниченными возможностями здоровья форм промежуточной аттестации по отношению к установленной продолжительности их сдачи:

- продолжительности сдачи зачёта или экзамена, проводимого в письменной форме, - не более чем на 90 минут;
- продолжительности подготовки обучающегося к ответу на зачёте или экзамене, проводимом в устной форме, - не более чем на 20 минут;
- продолжительности выступления обучающегося при защите курсовой работы - не более чем на 15 минут.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО и учебным планом по направлению 38.04.02 "Менеджмент" и магистерской программе "Финансовый менеджмент".

Приложение 2
к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.ОД.8 Управление финансовыми рисками (продвинутый курс)

Перечень литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

Направление подготовки: 38.04.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Финансовый менеджмент

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2018

Основная литература:

1. Галанов В. А. Производные финансовые инструменты : учебник / В. А. Галанов -2-е изд. перераб. и доп. -М.: ИНФРА-М, 2017. -211 с. (Высшее образование: бакалавриат) - www.dx.doi.org/10.12737/21804. ISBN -online: 978-5-16-105154-2.Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=610326>
2. Грачева М. В. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под редакцией Грачевой М. В. - М.: ЮНИТИ - ДАНА , 2015. - 544 с. : 0*90 1/16 ISBN 978-5-238-01506-4.
Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=882522>
3. 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 К'. 2013. -482 с. ISBN 978-5-394-01987-6. Режим доступа <http://znanium.com/bookread2.php?book=430664>
3. Шапкин А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: учебник для бакалавров / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. 6 - е изд. - М.: Издательско-торговая корпорация 'Дашков и К'. 2014.880 с. ISBN 978-5-394-02170-1. Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=450763>
4. Фомичев А. Н. Риск-менеджмент: учебное пособие / Фомичев А. Н. , -4-е изд. -М.: Дашков и К, 2016. - 372 с. ISBN 978-5-394-02767-8.
Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=937403>
5. Русанов Ю. Ю. Банковский риск-менеджмент: учебник : / под ред. Ю. Ю. Русанова. - М.: Магистр:/ НИЦ ИНФРА-М, 2017. - 480 с. ISBN 987-5-16-102550. Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=908230>

Дополнительная литература:

1. Балдин К. В. Управление инвестициями.: учебник для бакалавров / - М.: Дашков и К, 2016. 240 с. ISBN 978-5-394-02235-7 Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=515758>
2. Лукасевич И. Я. Инвестиции: учебник/ Лукасевич И. Я. -М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2017. -413 с. Режим доступа:<http://znanium.com/bookread2.php?book=614951>
3. Плотников А. Н. Учет факторов риска и неопределенности при оценке эффективности инвестиционных проектов: учеб. пос. / А. Н. Плотников. -М.: ИНФА-М, 2016. - 80 с. 60*90 1/16. ISBN 978-5-16-105472(jnline). Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=754387>
4. Дамодаран А. Инвестиционная оценка: инструменты и методы оценки любых активов / Дамодаран А. -9-е изд. перераб. и доп. -М.: Альпина Пабли., 2016. -1316 с. : 70*100 1/16 (переплет) ISBN 978-5-9614-5642-2. Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=912796>
5. Шарп У. Ф. Инвестиции: учебник / Шарп У.Ф., Александер Г. Д. , Бэйли Д. З. -М.; НИЦ ИНФРА -М, 2016. -1040 с. :70*100 1/16. - (Университетский учебник. Бакалавриат) ISBN 978-5-16-002595-7/ Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=551364>

Приложение 3
к рабочей программе дисциплины (модуля)
Б1.В.ОД.8 Управление финансовыми рисками (продвинутый
курс)

Перечень информационных технологий, используемых для освоения дисциплины (модуля), включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Направление подготовки: 38.04.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Финансовый менеджмент

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2018

Освоение дисциплины (модуля) предполагает использование следующего программного обеспечения и информационно-справочных систем:

Операционная система Microsoft Windows 7 Профессиональная или Windows XP (Volume License)

Пакет офисного программного обеспечения Microsoft Office 365 или Microsoft Office Professional plus 2010

Браузер Mozilla Firefox

Браузер Google Chrome

Adobe Reader XI или Adobe Acrobat Reader DC

Kaspersky Endpoint Security для Windows

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе "ZNANIUM.COM", доступ к которой предоставлен обучающимся. 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, учебно-методические комплексы, 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 образования (ФГОС ВО) нового поколения.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе Издательства "Лань", доступ к которой предоставлен обучающимся. 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.