

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



**УТВЕРЖДАЮ**  
Проректор по образовательной деятельности КФУ  
\_\_\_\_\_ Турилова Е.А.  
"\_\_\_" \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

## **Программа дисциплины**

Корпоративный риск-менеджмент

Направление подготовки: 38.03.01 - Экономика

Профиль подготовки: Корпоративные финансы

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2024

## 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-6	Способность критически оценивать варианты финансовых и инвестиционных решений с учетом рисков, выбирать методы воздействия на риски в контексте их видов

Обучающийся, освоивший дисциплину (модуль):

Должен знать:

- цель и задачи организации риск-менеджмента в корпорации, генезис развития риск-менеджмента и характерные черты корпоративного (интегрированного риск-менеджмента), источники информации для оценки уровня рисков, меры риска, методы расчета и анализа показателей, характеризующих уровень рисков, методы и инструменты учета и мониторинга уровня финансовых рисков в контексте их видов;
- законодательство РФ и отраслевые стандарты по управлению рисками, базовые положения международных стандартов риск-менеджмента, применяемые в риск-менеджменте нормы корпоративного управления и корпоративной культуры, современные теории портфельного инвестирования и методики интегрированной оценки финансовых рисков, методы и инструменты моделирования и формирования оптимальных и рациональных решений с учетом риска.

Должен уметь:

- собрать необходимые данные для расчета экономических показателей, характеризующих уровень финансовых рисков корпорации, рассчитать необходимые количественные показатели, применять портфельный подход при оценке рисков, осуществлять оценку и мониторинг уровня финансовых рисков компании в контексте их видов, выбирать и применять критерии экономической эффективности и релевантные методы воздействия на уровень финансовых рисков, выбирать методы предупреждения рисков;
- применять портфельные теории при оценке рисков, инструментальные средства Ms Excel при выполнении расчетов, формировании вариантов оптимальных и рациональных решений с учетом риска, современные методики оценки рисков, применять методы анализа чувствительности и стохастического моделирования при решении задач риск-менеджмента, анализировать и интерпретировать полученные результаты для обоснования финансовых и инвестиционных решений с учетом критериев рис-доходность, выбирать методы предупреждения и воздействия на уровень различных финансовых рисков корпорации.

-  
-

**2. Место дисциплины (модуля) в структуре ОПОП ВО**

Данная дисциплина (модуль) включена в раздел "Б1.В.ДВ.04.01 Дисциплины (модули)" основной профессиональной образовательной программы 38.03.01 "Экономика (Корпоративные финансы)" и относится к дисциплинам по выбору части ОПОП ВО, формируемой участниками образовательных отношений.

Осваивается на 4 курсе в 7 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 6 зачетных(ые) единиц(ы) на 216 часа(ов).

Контактная работа - 80 часа(ов), в том числе лекции - 40 часа(ов), практические занятия - 40 часа(ов), лабораторные работы - 0 часа(ов), контроль самостоятельной работы - 0 часа(ов).

Самостоятельная работа - 100 часа(ов).

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

Форма промежуточного контроля дисциплины: экзамен в 7 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	Се-местр	Виды и часы контактной работы, их трудоемкость (в часах)						Самостоятельная работа
			Лекции, всего	Лекции в эл. форме	Практические занятия, всего	Практические в эл. форме	Лабораторные работы, всего	Лабораторные в эл. форме	
1.	Тема 1. Тема 1. Сущность и содержание риска как экономической категории	7	6	0	6	0	0	0	14
2.	Тема 2. Тема 2. Риск-менеджмент в корпорации	7	6	0	6	0	0	0	16
3.	Тема 3. Тема 3. Методология исследования и анализа рисков	7	6	0	6	0	0	0	14
4.	Тема 4. Тема 4. Сравнительная оценка вариантов решений в условиях полной неопределенности и риска	7	4	0	4	0	0	0	14
5.	Тема 5. Тема 5. Риски, связанные с инвестиционной деятельностью корпорации	7	6	0	6	0	0	0	14
6.	Тема 6. Тема 6. Состав, систематизация, методы анализа и управления финансовыми рисками корпорации	7	8	0	8	0	0	0	14
7.	Тема 7. Тема 7. Особенности управления рисками в коммерческих банках	7	4	0	4	0	0	0	14
	Итого		40	0	40	0	0	0	100

##### 4.2 Содержание дисциплины (модуля)

###### Тема 1. Тема 1. Сущность и содержание риска как экономической категории

Тема 1. Сущность и содержание риска как экономической категории

- 1) Неопределенность и риск, как неизбежные факторы экономической системы и предпринимательства.
- 2) Особенности категорий "риск" и "неопределенность", причины возникновения и природа экономических и предпринимательских рисков.
- 3) Эволюция взглядов на категории "риск" в мировой и отечественной экономической науке.
- 4) Риск как неизбежный фактор предпринимательской деятельности.
- 5) Системный подход к классификации предпринимательских и экономических рисков, критерии классификации экономических рисков.

###### Тема 2. Тема 2. Риск-менеджмент в корпорации

Тема 2. Риск-менеджмент в корпорации

- 1) Генезис развития риск-менеджмента в зарубежной и отечественной экономической науке и практике.
- 2) Сущность, цель, задачи, принципы, внешние и внутренние факторы системы управления рисками компании.
- 3) Системный подход к управлению рисками и основные этапы процесса управления рисками.
- 4) Содержание основных методов воздействия на уровень финансовых рисков корпорации.
- 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 нормативно-правового обеспечения управления рисками.
- 9) Этапы эволюции риск-менеджмента и современные концепции развития риск-менеджмента.

10) Содержание корпоративного риск-менеджмента.

Тема 3. Методология исследования и анализа рисков

### **Тема 3. Методология исследования и анализа рисков**

Тема 3. Методология исследования и анализа рисков

- 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 4. Сравнительная оценка вариантов решений в условиях полной неопределенности и риска**

Тема 4. Сравнительная оценка вариантов решений в условиях полной неопределенности и риска

- 1) Применение теории игр, матричных игр, игр с природой.
- 2) Содержание и порядок заполнения данными матрицы эффективности, матрицы затрат, матрицы упущенной выгоды.
- 3) Сущность минимаксных 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 5. Риски, связанные с инвестиционной деятельностью корпорации**

Тема 5. Риски, связанные с инвестиционной деятельностью корпорации

- 1) Систематизация рисков инвестиционной деятельности.
- 2) Систематизация и содержание подходов к оценке рисков инвестиционной деятельности корпорации.
- 3) Содержание и применение портфельного подхода к оценке рисков портфеля ценных бумаг.
- 4) Методы оценки рисков инвестиционной деятельности.
- 5) Концепция приемлемого риска и методы снижения риска инвестиционной деятельности.
- 6) Инвестиционный проект как объект риск-менеджмента.
- 7) Методология риск-менеджмента инвестиционного проекта.
- 8) Классификация проектных рисков и инструменты риск-анализа инвестиционного проекта.
- 9) Методы учета рисков инвестиционного проекта: метод оценки ставки дисконтирования, модель оценки капитальных активов, метод кумулятивного построения ставки дисконта.
- 10) Современные методы и инструменты риск-менеджмента инвестиционного проекта.
- 11) Компьютерный инструментарий проектного риск-менеджмента

### **Тема 6. Состав, систематизация, методы анализа и управления финансовыми рисками корпорации**

Тема 6. Состав, систематизация, методы анализа и управления финансовыми рисками корпорации

- 1) Место финансовых рисков в общей иерархии рисков.
- 2) Сущность и систематизация типичных финансовых рисков корпорации по различным критериям..
- 3) Принципы и содержание политики управления финансовыми рисками.
- 4) Исследование факторов, влияющих на уровень финансовых рисков корпорации.
- 5) Связь операционного и финансового рычага с совокупным риском корпорации.
- 6) Методы снижения уровня финансовых рисков корпорации: диверсификация, страхование, хеджирование, лимитирование, самострахование (резервирование), хеджирование и передача.
- 7) Базовые понятия, связанные с управлением ликвидностью и рисками потери ликвидности. Риск ликвидности - методики анализа, оценки и снижения. Риски недостаточной и избыточной ликвидности, риски снижения платежеспособности, риски рыночной ликвидности.
- 8) Финансовая отчетность организации как источник информации для оценки уровня рисков балансовой ликвидности.
- 9) Оценка рисков снижения ликвидности при помощи абсолютных показателей.

- 10) Оценка рисков потери балансовой ликвидности при помощи относительных показателей. Интегральная оценка рисков снижения ликвидности.
- 11) Риски снижения финансовой устойчивости и потери финансовой независимости. Факторы риска.
- 12) Финансовая отчетность организации как источник диагностики уровня рисков снижения финансовой устойчивости.
- 13) Методики оценки рисков снижения финансовой устойчивости при помощи абсолютных и относительных показателей. Состав показателей и порядок их расчета. Интегральная оценка рисков снижения финансовой устойчивости корпорации.
- 14) Кредитные риски компании. Факторы, определяющие уровень кредитных рисков. Методы и инструменты оценки кредитных рисков и рисков дефолта. Методы снижения кредитных рисков.
- 15) Рыночные риски в деятельности корпораций. Систематизация и сущность рыночных рисков корпораций.
- 16) Понятие, виды и факторы процентного риска. Методические подходы к оценке степени процентного риска. Мероприятия по снижению процентного риска.
- 17) Валютные риски - сущность, состав и факторы валютных рисков. Методы оценки и снижения валютных рисков.
- 18) Фондовый риск - сущность, факторы и методы оценки. Методы снижения фондовых рисков. Современные методики комплексной оценки рыночных рисков.
- 19) Хеджирование ценовых рисков при помощи форвардных, фьючерсных контрактов и опционных контрактов.

### **Тема 7. Особенности управления рисками в коммерческих банках**

Тема 7. Особенности управления рисками в коммерческих банках

1. Риски как составляющая банковской деятельности. Состав, сущность, особенности банковских рисков, факторы изменения их уровня.
2. Качественный и количественный анализ рисков в банковской сфере - используемые методы.
3. Особенности организации риск-менеджмента в коммерческих банках.
4. Нормативно-правовое обеспечение регулирования финансовых рисков в банковской сфере.
5. Методы оценки и управления кредитными рисками в банковской сфере.
6. Методы оценки и управления рисками ликвидности.
7. Методы оценки и снижения рыночных рисков.
8. Процентные риски в коммерческих банках - методы анализа и снижения.
9. Операционные риски в банковской сфере и риски потери репутации.
10. Современные проблемы организации эффективного банковского риск-менеджмента.

### **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 науки и высшего образования Российской Федерации от 6 апреля 2021 года №245)

Письмо Министерства образования Российской Федерации №14-55-99бин/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

### **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 планируемым результатам 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)**

Yahoo финансы - <http://finance.yahoo.com>

Информационный портал Московской биржи - <http://www.micex.ru>

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

Официальный сайт Центрального банка России РФ - <http://www.cbr.ru>

Портал Блумберг - <http://www.bloomberg.com>

Страница А.Дамодарана - <http://people.stern.nyu.edu/adamodar>

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



Вид работ	Методические рекомендации
лекции	<p>Дисциплина считается освоенной, если обучающийся имеет положительные результаты промежуточного и текущего контроля. Это означает, что был освоен необходимый уровень теоретических знаний и получены необходимые практические навыки по дисциплине.</p> <p>Для достижения вышеуказанного обучающийся должен соблюдать следующие правила, позволяющие освоить дисциплину на высоком уровне:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Перед началом курса целесообразно ознакомиться со структурой дисциплины на основании программы, а также с последовательностью изучения тем и их объемом. С целью оптимальной самоорганизации необходимо сопоставить эту информацию с графиком занятий и выявить наиболее затратные по времени и объему темы, чтобы заранее определить для себя периоды выполнения объемных заданий. Начало освоения курса должно быть связано с требованиями по дисциплине, которые будут доведены до сведения обучающихся на первой лекции и первом семинарском занятии: <ul style="list-style-type: none"> <li>- установленные сроки контроля выполнения практических заданий каждым студентом,</li> <li>- распределение тем рефератов и докладов и сроки их представления и защиты,</li> <li>- критерии оценки текущей работы студента (контрольных работ, решения кейсов, выполнения индивидуальных практических заданий в классе ПК, тем докладов и рефератов на семинарских/практических занятиях).</li> </ul> </li> <li>2. Необходимо заранее обеспечить себя необходимыми материалами и литературой по темам дисциплины или доступом к ним.</li> <li>3. Лекционный материал и литературные источники по соответствующей теме необходимо изучить до посещения соответствующего лекционного занятия, так как лекция в аудитории предполагает раскрытие актуальных и проблемных вопросов рассматриваемой темы, а не содержания лекционного материала. Таким образом, для понимания того, что будет сказано на лекции, необходимо получить заранее базовые знания по теме лекции.</li> </ol>
практические занятия	<p>Практические и семинарские занятия по дисциплине проводятся в виде семинарских занятий и большая часть проводится с выполнением заданий в классе ПК. В процессе которых преимущественно осуществляется контроль знаний, полученных студентом на лекциях и самостоятельно. В связи с этим такое занятие начинается либо с устного опроса, либо с тестирования по теме, либо с контрольной работы. В связи с этим подготовка к практическому занятию заключается в том, что бы до занятия</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>- изучить лекционный материал и указанные по теме литературные источники;</li> <li>- выполнить практические задания и задания для самостоятельной работы.</li> </ul>
самостоятельная работа	<p>Программой учебной дисциплины предусмотрена организация самостоятельной работы студентов. По многим темам учебной дисциплины предусмотрено выполнение практических заданий в среде Ms Excel по вариантам. Указанные вопросы и задания должны прорабатываться и выполняться студентами самостоятельно. Преподаватель может вынести их на обсуждение во время проведения практического занятия.</p>
экзамен	<p>Экзамен по дисциплине нацелен на комплексную проверку освоения дисциплины. Экзамен проводится в письменной форме по билетам, в которых содержатся вопросы по темам и задачи, решаемые письменно. Обучающемуся даётся время на подготовку по билету. Оценивается владение материалом, его системное освоение, способность применять нужные знания, навыки и умения при анализе проблемных ситуаций и решении практических заданий.</p>

**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 38.03.01 "Экономика" и профилю подготовки "Корпоративные финансы".

### Перечень литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

Направление подготовки: 38.03.01 - Экономика

Профиль подготовки: Корпоративные финансы

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2024

#### Основная литература:

1. Домашенко, Д. В. Современные подходы к корпоративному риск-менеджменту: методы и инструменты / Д. В. Домашенко, Ю. Ю. Финогенова. - Москва : Магистр : ИНФРА-М, 2019. - 304 с. - ISBN 978-5-9776-0427-7. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1006768> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
2. Исаев, Р. А. Банковский менеджмент и бизнес-инжиниринг : в 2 томах. Том 2 / Р.А. Исаев. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : ИНФРА-М, 2023. - 336 с. - ISBN 978-5-16-010459-1. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1996441> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
3. Казакова, Н. А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски : учебник / Н.А. Казакова. - Москва : ИНФРА-М, 2024. - 258 с. - (Высшее образование: Магистратура). - DOI 10.12737/1989243. - ISBN 978-5-16-018380-0. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1989243> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
4. Шапкин, А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций : учебник / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 10-е изд., перераб. - Москва : Издательско-торговая корпорация 'Дашков и К-', 2023. - 874 с. - ISBN 978-5-394-05397-9. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2041752> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
5. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под ред. М.В. Грачевой, А.Б. Секерина. - Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2017. - 544 с. - ISBN 978-5-238-01506-4. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1028577> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
6. Балдин, К. В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К. В. Балдин, И. И. Передеряев, Р. С. Голов. - 6-е изд., стер. - Москва : Дашков и К, 2023. - 418 с. - ISBN 978-5-394-05185-2. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2084842> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
7. Бондаренко, О. Г. Управление коммерческим риском : учебное пособие / О. Г. Бондаренко, В. Т. Гришина. - 4-е изд., перераб. и доп. - Москва : Дашков и К, 2022. - 147 с. - ISBN 978-5-394-05004-6. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2084832> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.

#### Дополнительная литература:

1. Энциклопедия финансового риск-менеджмента / под ред. А. А. Лобанова, А. В. Чугунова. - 4-е изд., испр. и доп. - Москва : Альпина Бизнес Букс, 2009. - 932 с. - ISBN 978-5-96142-284-9. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1077955> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
2. Инвестиции : учебник / М.И. Ермилова, Е.В. Алтухова, Н.В. Грызунова [и др.]. - Москва : ИНФРА-М, 2022. - 287 с. - (Высшее образование: Бакалавриат). - DOI 10.12737/1079032. - ISBN 978-5-16-016047-4. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1855794> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
3. Галанов, В. А. Производные финансовые инструменты : учебник / В.А. Галанов. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва : ИНФРА-М, 2024. - 221 с. - (Высшее образование). - DOI 10.12737/21804. - ISBN 978-5-16-012272-4. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1991026> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
4. Шапкин, А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций : учебник / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 10-е изд., перераб. - Москва : Издательско-торговая корпорация 'Дашков и К-', 2023. - 874 с. - ISBN 978-5-394-05397-9. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2041752> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.

5. Управление банковскими рисками : учебник / Е. В. Бережная, С. В. Зенченко, М. В. Сероштан, О. В. Бережная. - 2-е изд. - Москва : Дашков и К, 2022. - 180 с. - ISBN 978-5-394-04941-5. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2084824> (дата обращения: 17.01.2024). - Режим доступа: по подписке.

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

Направление подготовки: 38.03.01 - Экономика

Профиль подготовки: Корпоративные финансы

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2024

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.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе "Консультант студента", доступ к которой предоставлен обучающимся. Многопрофильный образовательный ресурс "Консультант студента" является электронной библиотечной системой (ЭБС), предоставляющей доступ через сеть Интернет к учебной литературе и дополнительным материалам, приобретенным на основании прямых договоров с правообладателями. Полностью соответствует требованиям федеральных государственных образовательных стандартов высшего образования к комплектованию библиотек, в том числе электронных, в части формирования фондов основной и дополнительной литературы.