

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 Менеджмент



УТВЕРЖДАЮ

Проректор по образовательной деятельности КФУ

_____ Турилова Е.А.

"__" _____ 20__ г.

Программа дисциплины

Управление финансовыми рисками

Направление подготовки: 38.03.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Финансовый менеджмент

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-3	Способен владеть навыками разработки, анализа и обоснования управленческих и финансовых стратегий организации, моделирования планирования и прогнозирования их деятельности, направленных на формирование конкурентоспособных бизнес-моделей, технологических и продуктовых инноваций, принятию эффективных инвестиционных решений с учетом рыночных и специфических рисков

Обучающийся, освоивший дисциплину (модуль):

Должен знать:

- разновидности финансовых рисков; методы воздействия на уровень финансовых рисков
- инструментальные средства для выполнения расчетов в среде Ms Excel; методики и инструменты; оптимизационного и стохастического моделирования; методы воздействия на уровень финансовых рисков;
- современные методики оценки рыночных рисков и вопросы организации эффективного финансового риск-менеджмента.

Должен уметь:

- оценивать альтернативные варианты управленческих решений с учетом финансовых рисков;
- обосновывать финансовые и инвестиционные решения с учетом рисков; применять инструментарий Ms Excel для количественной оценки финансовых рисков; инструментарий Ms Excel для осуществления оптимизационного и стохастического моделирования рисков ситуации; методы ранжирования финансовых рисков
- применять современные методики оценки рыночных рисков.

Должен владеть:

- методами обоснования финансовых и инвестиционных решений с учетом рисков, выбора рациональной стратегий в условиях риска и неопределенности; практическими навыками применения инструментарий Ms Excel для количественной оценки финансовых рисков и применения оптимизационного и стохастического моделирования рисков ситуации;
- методами количественной оценки воздействия рыночных рисков на стоимость финансовых активов с использованием методологии VAR.

-

2. Место дисциплины (модуля) в структуре ОПОП ВО

Данная дисциплина (модуль) включена в раздел "Б1.В.ДВ.04.02 Дисциплины (модули)" основной профессиональной образовательной программы 38.03.02 "Менеджмент (Финансовый менеджмент)" 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 4 зачетных(ые) единиц(ы) на 144 часа(ов).

Контактная работа - 64 часа(ов), в том числе лекции - 32 часа(ов), практические занятия - 32 часа(ов), лабораторные работы - 0 часа(ов), контроль самостоятельной работы - 0 часа(ов).

Самостоятельная работа - 80 часа(ов).

Контроль (зачёт / экзамен) - 0 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины: зачет с оценкой 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)						Само-стоя-тельная ра-бота
			Лекции, всего	Лекции в эл. форме	Практи-ческие занятия, всего	Практи-ческие в эл. форме	Лабора-торные работы, всего	Лабора-торные в эл. форме	
1.	Тема 1. Понятие, содержание, подходы к систематизации финансовых рисков	7	2	0	2	0	0	0	10
2.	Тема 2. Современный риск-менеджмент в компании. Содержание этапов и методов управления рисками.	7	4	0	4	0	0	0	11
3.	Тема 3. Методы выявления и анализа финансовых и деловых рисков	7	4	0	4	0	0	0	11
4.	Тема 4. Портфельный подход к управлению рисками. Содержание и применение портфельной теории Марковица при обосновании инвестиционных решений.	7	4	0	4	0	0	0	8
5.	Тема 5. Применение теории Шарпа и Росса при выборе альтернативы "риск-доходность" с учетом системного и факторного риска	7	4	0	4	0	0	0	8
6.	Тема 6. Риски снижения платежеспособности и финансовой устойчивости компании. Методики их оценки и методы воздействия.	7	2	0	2	0	0	0	8
7.	Тема 7. Кредитные риски и риск банкротства компании. Методы и модели оценки	7	4	0	4	0	0	0	8
8.	Тема 8. Систематизация рисков инвестиционной деятельности компании. Методы оценки и моделирования.	7	4	0	4	0	0	0	8
9.	Тема 9. Рыночные риски компании. Состав и методика оценки. Методика VAR.	7	4	0	4	0	0	0	8
	Итого		32	0	32	0	0	0	80

4.2 Содержание дисциплины (модуля)

Тема 1. Понятие, содержание, подходы к систематизации финансовых рисков

Тема 1. Понятие, содержание, подходы к систематизации финансовых рисков

1. Финансовые и деловые риски, как неизбежный фактор финансово-хозяйственной деятельности компаний.
2. Причины возникновения деловых и финансовых рисков и их содержание.
3. Эволюция взглядов на категорию риска в зарубежной и отечественной науке.
4. Информационный подход Найта к разграничению категорий риска и неопределенности.
5. Понятие и функции предпринимательских рисков.
6. Подходы к классификации финансовых и деловых рисков и критерии классификации.

Тема 2. Тема 2. Современный риск-менеджмент в компании. Содержание этапов и методов управления рисками.

Тема 2. Современный риск-менеджмент в компании. Содержание этапов и методов управления рисками.

1. Понятие и содержание риск-менеджмента организации.
2. Этапы эволюции риск-менеджмента.
3. Цель, задачи и содержание риск-менеджмента.
4. Обзор нормативно-правового обеспечения управления рисками в компании.
5. Последовательность и содержание этапов управления рисками.
6. Содержание корпоративного риск-менеджмента.
5. Методы снижения и нейтрализации рисков компании.

Тема 3. Тема 3. Методы выявления и анализа финансовых и деловых рисков

Тема 3. Методы выявления и анализа финансовых и деловых рисков

1. Меры риска. Характеристики уровня риска: дисперсия, стандартное отклонение, коэффициент вариации прибыли, дохода, доходности.
2. Методики количественной оценки деловых и финансовых рисков: вероятностный и статистический подходы.
3. Зональный метод оценки рисков.
4. Экспертные методы оценки и анализа рисков.
5. Минимаксные критерии выбора рациональных стратегий с учетом риска.

Тема 4. Тема 4. Портфельный подход к управлению рисками. Содержание и применение портфельной теории Марковица при обосновании инвестиционных решений.

Тема 4. Портфельный подход к управлению рисками. Содержание и применение портфельной теории Марковица при обосновании инвестиционных решений.

1. Содержание портфельного подхода к оценке и управлению рисками.
2. Содержание портфельной теории Марковица.
3. Применение теории Марковица при формировании фондового портфеля.
4. Понятие эффективного портфеля по Марковицу и применение оптимизационного подхода при формировании фондового портфеля компании.

Тема 5. Тема 5. Применение теории Шарпа и Росса при выборе альтернативы "риск-доходность " с учетом системного и факторного риска

Тема 5. Применение теории Шарпа и Росса при выборе альтернативы "риск-доходность " с учетом системного и факторного риска

1. Понятие системного риска и теория применение теории Шарпа при выборе альтернативы "риск-доходность".
2. Понятие факторного риска и арбитражная теория Росса в риск-анализе.
3. Понятие арбитражного портфеля, применение факторного анализа при обосновании инвестиционных решений.
4. Примеры формирования арбитражных портфелей.

Тема 6. Тема 6. Риски снижения платежеспособности и финансовой устойчивости компании. Методики их оценки и методы воздействия.

Тема 6. Риски снижения платежеспособности и финансовой устойчивости компании. Методики их оценки и методы воздействия.

1. Сущность и факторы рисков снижения платежеспособности компании.
2. Методика оценки рисков потери платежеспособности при помощи абсолютных показателей.
3. Содержание методики оценки и анализа рисков потери платежеспособности при помощи относительных показателей(коэффициентов).
4. Содержание и факторы риска снижения финансовой устойчивости компании.
5. Методики оценки и анализа рисков снижения финансовой устойчивости при помощи абсолютных и относительных показателей.

Тема 7. Тема 7. Кредитные риски и риск банкротства компании. Методы и модели оценки

Тема 7. Кредитные риски и риск банкротства компании. Методы и модели оценки

1. Состав и сущность кредитных рисков. Понятие кредитного рейтинга. Мировые рейтинговые агентства.
2. Применение методики кредитного скоринга при диагностике риска кредитного риска.

3. Риск банкротства. Методы диагностики риска банкротства.
4. Применение дискриминантных, рейтинговых моделей диагностики риска банкротства.

Тема 8. Тематизация рисков инвестиционной деятельности компании. Методы оценки и моделирования.

Тема 8. Тематизация рисков инвестиционной деятельности компании. Методы оценки и моделирования.

1. Подходы к тематизации рисков инвестиционной деятельности компании.
2. Понятие риска инвестиционного проекта и проведение риск-анализа инвестиционного проекта.
3. Ранжирование рисков инвестиционного проекта при помощи анализа чувствительности.
4. Применение имитационного моделирования по методу Монте-Карло в риск-анализе.
5. Методы снижения инвестиционных рисков компании.

Тема 9. Тематизация рыночных рисков компании. Состав и методики оценки. Методика VAR.

Тема 9. Рыночные риски компании. Состав и методики оценки. Методика VAR.

1. Понятие и состав рыночных рисков компании.
2. Содержание процентных, валютных, фондовых и ценовых рисков.
3. Методы анализа рыночных рисков компании.
4. Методика оценки воздействия рыночных рисков при помощи расчета абсолютного VAR.
5. Применение методики расчета относительного VaR при оценке чувствительности портфеля к воздействию рыночных 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 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

Московская межбанковская валютная биржа - [http:// www.micex.ru](http://www.micex.ru)

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

Сайт Центрального банка России - www.cbr.ru

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)

Аналитическая информация о финансовых рынках - [http:// www.k2kapital.com](http://www.k2kapital.com)

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](http://www.cbr.ru)

СПС Консультант Плюс - <http://www.consultant.ru>

Финансовые риски - <http://www.finrisk.ru>

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"> 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"> - установленные сроки контроля выполнения практических заданий каждым студентом, - распределение тем рефератов и докладов и сроки их представления и защиты, - критерии оценки текущей работы студента (контрольных работ, решения кейсов, выполнения индивидуальных практических заданий в классе ПК, тем докладов и рефератов на семинарских/практических занятиях). 2. Необходимо заранее обеспечить себя необходимыми материалами и литературой по темам дисциплины или доступом к ним. 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.

Вид работ	Методические рекомендации
практические занятия	Практические и семинарские занятия по дисциплине проводятся в виде семинарских занятий и практических в классе ПК. В процессе практических и семинарских занятий преимущественно осуществляется контроль знаний, полученных студентом на лекциях и самостоятельно. В связи с этим такое занятие начинается либо с устного опроса, либо с дискуссии, либо с тестирования по теме, либо с контрольной работы. В связи с этим подготовка к практическому занятию заключается в том, что бы до занятия - изучить лекционный материал и относящиеся к теме литературные источники.
самостоятельная работа	Программой учебной дисциплины предусмотрена организация самостоятельной работы студентов. По каждой теме учебной дисциплины преподаватель дает в электронном виде: список рекомендуемой литературы, вопросы для контроля знаний, вопросы для подготовки к семинару, практические задания и задания для самостоятельной работы. Вопросы для контроля знаний и задания для самостоятельного выполнения позволят студентам более глубоко освоить программу дисциплины. Указанные вопросы и задания должны прорабатываться и выполняться студентами самостоятельно По многим темам учебной дисциплины предусмотрено выполнение студентами практических заданий в среде Ms Excel по вариантам.
зачет с оценкой	Зачет по дисциплине нацелен на комплексную проверку освоения дисциплины. Зачет проводится в устной 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.

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 38.03.02 "Менеджмент" и профилю подготовки "Финансовый менеджмент".

Перечень литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

Направление подготовки: 38.03.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Финансовый менеджмент

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2024

Основная литература:

1. Окулов В.А. Риск-менеджмент: основы теории и практика применения: учебное пособие/В.А.Окулов.. - Спб.: Изд-во СПб. Гос. Ун-та, 2019. - 280 с. ISBN 978-5-288-05936-0.- Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/document?id=353364> (дата обращения 20.01.2024) - Режим доступа: по подписке
2. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под ред. М.В. Грачевой, А.Б. Секерина. - М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2017. - 544 с. - ISBN 978-5-238-01506-4. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1028577> (дата обращения 20.01.2024) - Режим доступа: по подписке
3. Фомичев, А. Н. Риск-менеджмент : учебник / А. Н. Фомичев. - 10-е изд. - Москва : Дашков и К, 2023. - 366 с. - ISBN 978-5-394-05406-8. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2084174> (дата обращения: 23.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
4. Винс, Р. Математика управления капиталом: Методы анализа риска для трейдеров и портфельных менеджеров /Р. Винс . - 4-е изд. - Москва :Альпина Пабли., 2016. - 400 с.: ISBN 978-5-9614-1529-2. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/914276> (дата обращения: 20.01.2024). - Режим доступа: по подписке
5. Воробьев, С. Н. Управление рисками в предпринимательстве [Электронный ресурс] / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - 4-е изд., испр. - Москва : Издательско-торговая корпорация 'Дашков и Ко', 2013. - 482 с. - ISBN 978-5-394-01987-6. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/430664> (дата обращения: 20.01.2024). - Режим доступа: по подписке

Дополнительная литература:

1. Шапкин, А. С. Управление портфелем инвестиций ценных бумаг : учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 8-е изд., перераб. - Москва : Издательско-торговая корпорация 'Дашков и К-', 2023. - 505 с. - ISBN 978-5-394-05413-6. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2041756> (дата обращения: 23.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
2. 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: 23.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
3. Домашенко, Д. В. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Д.В. Домашенко, Ю.Ю. Финогенова. - Москва : Магистр, ИНФРА-М Издательский Дом, 2015. - 240 с. ISBN 978-5-9776-0138-2. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/502885> (дата обращения: 20.01.2024). - Режим доступа: по подписке
4. 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: 23.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
5. Новиков, А. И. Модели финансового рынка и прогнозирование в финансовой сфере : учебное пособие / А.И. Новиков. - Москва : ИНФРА-М, 2022. - 256 с. - (Высшее образование: Магистратура). - DOI 10.12737/924. - ISBN 978-5-16-005370-7. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1850685> (дата обращения: 23.01.2024). - Режим доступа: по подписке.

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

Направление подготовки: 38.03.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Финансовый менеджмент

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.