

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

\_\_\_\_\_ Турилова Е.А.  
"\_\_\_" \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

## **Программа дисциплины**

Финансовый риск-менеджмент (продвинутый уровень)

Направление подготовки: 38.04.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Финансовый менеджмент

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очно-заочное

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	Способен обрабатывать и анализировать информацию по рискам в отрасли и в организации, проводить диагностику существующей в организации практики управления рисками, анализировать и применять методики оценки управления рисками и реагирования на риски

Обучающийся, освоивший дисциплину (модуль):

Должен знать:

- базовые понятия финансового риск-менеджмента, внешние и внутренние источники информации, методы и инструменты расчета и анализа количественных показателей, характеризующих уровень финансовых рисков организации, отдельных финансовых активов, фондового портфеля организации, портфельные теории и подходы к оценке финансовых рисков, методы и инструменты воздействия на уровень финансовых рисков и их предупреждения, Законодательство РФ и отраслевые стандарты в области управления финансами рисками, критерии оценки эффективности управления финансовыми рисками;
- базовые положения международных стандартов в области организации интегрированного риск-менеджмента, методический инструментарий и возможности современных ИТ-технологий для реализации концепции интегрированного риск-менеджмента, методы мониторинга рисков, методы и технологии управления различными видами финансовых рисков, методы и инструменты внутреннего контроля рисков, методы предупреждения рисков, нормы профессиональной этики, нормы корпоративного управления и корпоративной этики.

Должен уметь:

- применять базовые концепции организации интегрированной системы риск-менеджмента, методы сбора и анализа необходимой информации из внешних и внутренних источников, законодательство РФ и отраслевые стандарты в области управления рисками, применять типовые методики расчета количественных показателей для оценки рисков в контексте их видов, применять методы анализа и мониторинга финансовых рисков, обосновывать выбор инвестиционного или финансового решения, исходя из соотношения - риск-доходность, методы оценки эффективности управления рисками, выбирать и обосновывать мероприятия по воздействию на уровень финансовых рисков;
- применять базовые положения международных стандартов в области организации интегрированного риск-менеджмента, методический инструментарий и возможности современных ИТ-технологий для реализации концепции интегрированного риск-менеджмента, методы мониторинга финансовых рисков, методы и технологии управления различными видами финансовых рисков, методы и инструменты внутреннего контроля рисков, методы предупреждения рисков, нормы профессиональной этики и корпоративной культуры.

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

Данная дисциплина (модуль) включена в раздел "Б1.В.04 Дисциплины (модули)" основной профессиональной образовательной программы 38.04.02 "Менеджмент (Финансовый менеджмент)" и относится к части ОПОП ВО, формируемой участниками образовательных отношений.

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 7 зачетных(ые) единиц(ы) на 252 часа(ов).

Контактная работа - 66 часа(ов), в том числе лекции - 22 часа(ов), практические занятия - 44 часа(ов), лабораторные работы - 0 часа(ов), контроль самостоятельной работы - 0 часа(ов).

Самостоятельная работа - 132 часа(ов).

Контроль (зачёт / экзамен) - 54 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	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. Финансовые риски в предпринимательской деятельности	3	4	0	4	0	0	0	20
2.	Тема 2. Интегрированный риск-менеджмент в компании	3	4	0	4	0	0	0	20
3.	Тема 3. Методы исследования и анализа финансовых рисков	3	4	0	10	0	0	0	30
4.	Тема 4. Риски инвестиционной деятельности компании	3	4	0	10	0	0	0	22
5.	Тема 5. Кредитные риски компании и риски угрозы банкротства	3	4	0	8	0	0	0	20
6.	Тема 6. Рыночные риски компании - современные методы и инструменты оценки	3	2	0	8	0	0	0	20
	Итого		22	0	44	0	0	0	132

**4.2 Содержание дисциплины (модуля)**

**Тема 1. Финансовые риски в предпринимательской деятельности**

- 1) Неопределенность и риск, как неизбежные факторы экономической системы и предпринимательства.
- 2) Особенности категорий "финансовые риски" и "неопределенность", причины возникновения и факторы рисков в предпринимательской деятельности.
- 3) Методы и инструменты оценки финансовых рисков в условиях неопределенности и риска. Выбор рациональной стратегии с применением теории игр.
- 4) Систематизация предпринимательских рисков, их сущность, методы и инструменты оценки и управления.
- 5) Понятие потенциальных деловых и финансовых рисков, методы анализа уровня рисков на базе оценки силы воздействия операционного, финансового и сопряженного левериджей.
- 6) Систематизация нормативно-правовой базы по управлению рисками: основы международных стандартов, отраслевые стандарты риск-менеджмента, раскрытие информации о рисках в отчетности публичных акционерных обществ (ПАО).
- 7) Методы и инструменты идентификации, мониторинга и внутреннего контроля финансовых рисков по их видам.

**Тема 2. Интегрированный риск-менеджмент в компании**

- 1) Генезис развития риск-менеджмента в зарубежной и отечественной экономической науке и практике.
- 2) Сущность, цель, задачи, принципы интегрированной системы управления рисками компании.
- 3) Методы и инструменты интегрированного риск-менеджмента в компании.
- 4) Содержание методов предупреждения, мониторинга и воздействия на уровень финансовых рисков корпорации.
- 5) Внешние и внутренние источники информации об уровне финансовых рисков компании.
- 6) Характеристика информации, необходимой для оценки, мониторинга и управления финансовыми рисками компании.
- 7) Задачи и полномочия служб риск-менеджмента в компании.
- 8) Применение норм корпоративного управления и корпоративной этики в системе риск-менеджмента компании.
- 9) Современные проблемы и дискуссионные вопросы организации эффективного риск-менеджмента компании.

### **Тема 3. Методы исследования и анализа финансовых рисков**

- 1) Содержание различных методов идентификации финансовых рисков: опросные листы, структурные диаграммы, карты потоков, инспекции, анализ финансовой и управленческой отчетности.
- 2) Меры риска и применение качественного и количественного анализа финансовых рисков.
- 3) Применение статистического и вероятностного подходов в оценке финансовых рисков.
- 4) Применение оптимизационных моделей в финансовом риск-менеджменте.
- 5) Взаимосвязь финансового и операционного рычагов компании с уровнем финансовых и деловых рисков.
- 6) Применение зонального метода оценки финансовых рисков.
- 7) Применение деревьев решений в финансовом риск-менеджменте.
- 8) Применение экспертных методов в оценке финансовых рисков.
- 9) Отражение информации о существенных рисках компании при помощи карты рисков и представление информации об уровне рисков в отчетности компании.

### **Тема 4. Риски инвестиционной деятельности компании**

Риски инвестиционной деятельностью компании

- 1) Применение портфельного подхода и портфельных теорий в оценке инвестиционных рисков компании.
- 2) Применение портфельного подхода Марковица к оценке общего риска фондового портфеля рискованных активов.
- 3) Понятие диверсифицированного портфеля. Суть стратегии диверсификации фондового портфеля по Марковицу и ее отличие от "наивной диверсификации".
  - 1) Применение оптимизационного подхода к формированию фондового портфеля с учетом теории Марковица.
  - 4) Портфель из совокупности безрискового актива с рисковыми и применение теории Шарпа в оценке системного (рыночного) риска капитальных активов и портфеля. Применение теории Шарпа в оценке системного риска финансового актива и фондового портфеля.
  - 5) Факторный риск и применение теории Росса в инвестировании. Свойства арбитражного портфеля и примеры формирования арбитражного портфеля в соответствии с теорией Росса.
  - 6) Сущность и систематизация рисков инвестиционной деятельности корпорации. Анализ существующих подходов к управлению инвестиционными рисками.
  - 7) Методы оценки, учета, снижения уровня рисков фондового портфеля и инвестиционной деятельности компании.
  - 8) Понятие и содержание риска инвестиционного проекта, методы и инструменты их анализа, оценки и снижения. Ранжирование рисков инвестиционного проекта и применение метода анализа чувствительности.
  - 9) Методы и инструменты оценки устойчивости инвестиционного проекта. Применение метода Анализа чувствительности и стохастического моделирования Монте-Карло для построения кумулятивного профиля риска инвестиционного проекта.

### **Тема 5. Кредитные риски компании и риски угрозы банкротства**

- 1) Применение методов анализа и оценки рисков потери ликвидности и платежеспособности компании.
- 2) Методы и инструменты оценки и снижения рисков потери ликвидности и платежеспособности.
- 3) Методы и инструменты анализа и оценка рисков снижения финансовой устойчивости и потери финансовой независимости компании.
- 4) Кредитные риски компании - состав, факторы, методы анализа, оценки, снижения.
- 5) Риски угрозы банкротства (дефолта) компании - методы и модели диагностики.
- 6) Кредитные риски в деятельности коммерческих банков. Особенности анализа оценки уровня кредитных рисков.
- 7) Методы и инструменты регулирования кредитных рисков в банковской сфере.

### **Тема 6. Рыночные риски компании - современные методы и инструменты оценки**

- 1) Рыночные риски в деятельности компаний. Систематизация и сущность рыночных рисков.
- 2) Понятие, виды и факторы процентного риска. Методы и инструменты оценки и снижения процентного риска.
- 3) Валютные риски - сущность, состав и факторы валютных рисков. Применение методов оценки и снижения валютных рисков.
- 4) Фондовый (ценовой) риск - сущность, факторы и методы оценки. Методы снижения фондовых рисков.
- 5) Современные методики комплексной оценки рыночных рисков (методика VAR).
- 6) Методы и инструменты хеджирования рыночных рисков при помощи производных финансовых инструментов.
- 7) Применение форвардных, фьючерсных и опционных контрактов с целью хеджирования рыночных рисков компании.

## **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)**

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

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

Официальный сайт независимого проекта "Корпоративный менеджмент" - <http://www.cfin.ru>

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

Справочно-правовая система Консультант Плюс - <http://www.consultant.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. 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.</p> <p>Обучающийся должен заранее обеспечить себя необходимыми материалами и литературой по темам дисциплины или обеспечить доступом к ним.</p> <p>До посещения соответствующего лекционного занятия по определенной теме, необходимо ознакомиться с материалами по теме лекции, так как лекция в аудитории предполагает раскрытие актуальных и проблемных вопросов рассматриваемой темы, а не содержания всего лекционного материала. Таким образом, для понимания того, что будет сказано на лекции, необходимо получить самостоятельно заранее базовые знания по теме лекции.</p>
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. Обучающиеся защищают выполненные задания во время практических и семинарских занятий.</p>
экзамен	<p>Экзамен по дисциплине нацелен на комплексную проверку освоения обучающимися теоретических и практических вопросов дисциплины. Экзамен проводится по билетам в устной форме. Билет содержит два вопроса по теории и задачу, решаемую письменно. На экзамене оценивается теоретическое и практическое владение материалом, его системное освоение, способность применять нужные знания и умения при анализе проблемных ситуаций и решении конкретных задач финансового риск-менеджмента.</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.

## **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.04 Финансовый риск-менеджмент (продвинутый уровень)

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

Направление подготовки: 38.04.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Финансовый менеджмент

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очно-заочное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2024

**Основная литература:**

1. Галанов, В. А. Производные финансовые инструменты : учебник / В.А. Галанов. - 2-е изд, перераб. и доп.- Москва : ИНФРА-М, 2021. - 221 с. - (Высшее образование: Бакалавриат). - DOI 10.12737/21804. - ISBN 978-5-16-012272-4. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1255298> (дата обращения:18.01.2024). - Режим доступа: по подписке.
2. Домашенко, Д. В. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Домашенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. - 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: 18.01.2024)
3. Ряховская, А. Н. Риск-менеджмент - основа устойчивости бизнеса : учебное пособие / А. Н. Ряховская, О. Г. Крюкова, М. О. Кузнецова ; под ред. О. Г. Крюковой. - Москва : Магистр : ИНФРА-М, 2022. - 256 с. - ISBN 978-5-9776-0487-1. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.ru/catalog/product/1891646> (дата обращения: 29.03.2024). - 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: 29.03.2024). - Режим доступа: по подписке.
5. Шарп, У. Ф. Инвестиции : учебник / У. Ф. Шарп, Г. Д. Александер, Д. В. Бэйли ; пер. с англ. А. Н. Буренина, А. А. Васина. - Москва : ИНФРА-М, 2021. - 1028 с. - (Университетский учебник: Бакалавриат). - ISBN 978-5-16-016789-3. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1149645> (дата обращения: 29.03.2024)

**Дополнительная литература:**

1. 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: 18.01.2024)
2. 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: 29.03.2024). - Режим доступа: по подписке.
3. Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций : учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 12-е изд. перераб. - Москва : Издательско-торговая корпорация 'Дашков и К-', 2023. - 538 с. - ISBN 978-5-394-05412-9. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2041758> (дата обращения: 29.03.2024). - Режим доступа: по подписке.

*Приложение 3  
к рабочей программе дисциплины (модуля)  
Б1.В.04 Финансовый риск-менеджмент (продвинутый уровень)*

**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: очно-заочное

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.