

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



*подписано электронно-цифровой подписью*

## Программа дисциплины

Банковский риск-менеджмент

Направление подготовки: 38.04.08 - Финансы и кредит

Профиль подготовки: Финансовая аналитика

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очно-заочное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2025

## 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. Булатова Э.И. (Кафедра финансовых рынков и финансовых институтов, Институт управления, экономики и финансов), bulatovaei@yandex.ru

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

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

<b>Шифр компетенции</b>	<b>Расшифровка приобретаемой компетенции</b>
ОПК-2	Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем;
ПК-1	Способен владеть методами аналитической работы, связанными с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и местного самоуправления

Обучающийся, освоивший дисциплину (модуль):

Должен знать:

- инструментарий и методику проведения анализа финансово-экономической информации, необходимой для принятия организационно-управленческих решений.
- источники и методы сбора исходной финансово-экономической информации, необходимой для принятия организационно-управленческих решений.
- механизм функционирования и потенциальные 'точки роста' проблем в объекте воздействия.
- технологию принятия управленческих решений, методы экономического и финансового их обоснования.
- порядок внедрения и внедрения финансово-экономического и/или организационно-управленческого решение в профессиональной деятельности.
- критерии оценки эффективности принятого финансово-экономического и/или организационно-управленческого решение в профессиональной деятельности.
- основы теории финансово-экономических рисков, принципы и методы управления ими.
- факторы возникновения и особенности проявления финансово-экономических рисков у различных экономических агентов.
- алгоритмы, методы и критерии оценки финансово-экономических рисков.
- методы анализа и оптимизации бизнес-процессов экономических агентов / финансовой деятельности индивидуума в целях управления финансово-экономическими рисками.
- основные стратегии поведения экономических агентов на различных сегментах финансовых рынков.
- порядок составления и заключения договора об информационном обеспечении инвестиционных программ и мероприятий.

Должен уметь:

- аргументировано, профессионально и доступно обосновывать разработанную стратегию поведения клиента на различных сегментах финансового рынка.
- осуществлять сбор релевантной информации для выявления необходимости принятия финансово-экономических и организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности.
- разрабатывать сценарии развития ситуации в профессиональной деятельности.
- формулировать варианты финансово-экономических и/или организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности.
- вести мониторинг хода выполнения принятого управленческого решения.
- анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчётности организаций и ведомств.
- критерии отбора эффективных финансово-экономических и/или организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности.
- критически оценивать варианты финансово-экономических и/или организационно-управленческих решений в профессиональной деятельности с учетом поставленной цели развития, наличия ресурсов, учета рисков.

- оценить временной интервал, требуемый для получения ожидаемого результата и, по истечении его, провести оценку эффективности реализуемого управленческого решения.
- критически осмысливать результаты анализа текущей ситуации в профессиональной деятельности и делать выводы о необходимости принятия финансово-экономических и организационно-управленческих решений.
- обосновывать уникальное финансово-экономическое и/или организационно-управленческое решение в профессиональной деятельности.
- принимать на себя ответственность за принятое финансово-экономическое и/или организационно-управленческое решение в профессиональной деятельности.
- вести корректировку ранее принятого управленческого решения в целях достижения наибольшей эффективности.
- выявлять основные финансово-экономические риски экономических агентов и причины их возникновения, систематизировать риски.
- предлагать механизмы управления финансово-экономическими рисками.
- вести качественную и/или количественную оценку финансово-экономических рисков.
- анализировать бизнес-процессы экономических агентов / финансовую деятельность индивидуума на предмет возникновения и возможности управления финансово-экономическими рисками.
- вести анализ тенденций на финансовых рынках на предмет актуальных стратегий поведения экономических агентов.
- соотносить конкретные методы управления финансово-экономическими рисками с базовыми стратегиями поведения экономических агентов на различных сегментах финансовых рынков
- разрабатывать индивидуальную стратегию поведения клиента на финансовых рынках с учетом оценки финансово-экономических рисков.
- 
- 

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

Данная дисциплина (модуль) включена в раздел "Б1.В.ДВ.05.02 Дисциплины (модули)" основной профессиональной образовательной программы 38.04.08 "Финансы и кредит (Финансовая аналитика)" и относится к дисциплинам по выбору части ОПОП ВО, формируемой участниками образовательных отношений.

Осваивается на 3 курсе в 5 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 - 32 часа(ов), в том числе лекции - 14 часа(ов), практические занятия - 18 часа(ов), лабораторные работы - 0 часа(ов), контроль самостоятельной работы - 0 часа(ов).

Самостоятельная работа - 112 часа(ов).

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

Форма промежуточного контроля дисциплины: зачет в 5 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. Система показателей банковских рисков	5	2	0	2	0	0	0	16
2.	Тема 2. Управление кредитным риском	5	2	0	4	0	0	0	16

N	Разделы дисциплины / модуля	Семестр	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	
3.	Тема 3. Управление риском ликвидности	5	2	0	4	0	0	0	16
4.	Тема 4. Управление рыночным риском	5	2	0	2	0	0	0	16
5.	Тема 5. Управление операционным риском	5	2	0	2	0	0	0	16
6.	Тема 6. Внутренний контроль как элемент управления банковскими рисками	5	2	0	2	0	0	0	16
7.	Тема 7. Стресс-тестирование как элемент прогнозирования и управления рисками	5	2	0	2	0	0	0	16
	Итого		14	0	18	0	0	0	112

#### 4.2 Содержание дисциплины (модуля)

##### Тема 1. Система показателей банковских рисков

Сущность банковских рисков для целей управления банком. Способы оценки и критерии рисков. Классификация банковских рисков. Факторы риска. Уровень риска. Идентификация риска. Мониторинг риска. Качественный анализ источников риска. Количественный анализ риска. Основные методы снижения риска. Страхование как метод снижения банковских рисков

##### Тема 2. Управление кредитным риском

Основные объекты, причины возникновения кредитного риска. Способы анализа и управления кредитным риском. Метод коэффициентов (нормативный подход). Концентрация кредитного риска (географическая, отраслевая и прочая). Нормативы, регулирующие кредитные риски. Формирование кредитной политики банка как элемент эффективности управления кредитным риском.

##### Тема 3. Управление риском ликвидности

Сущность и принципы управления ликвидностью банка. Платежеспособность и ликвидность банка. Цели управления ликвидностью банка. Показатели ликвидности. Способы прогнозирования ликвидной позиции банка. Факторы сокращения и потери ликвидности банка. Оперативный и стратегический способы управления ликвидностью.

##### Тема 4. Управление рыночным риском

Рыночный риск; фондовый риск; процентный риск; валютный риск; товарный риск; методы оценки рыночного риска; мониторинг рыночного риска; совокупная величина рыночного риска; финансовые инструменты; длинная позиция; короткая позиция; чистая позиция; открытая (закрытая) позиция; брутто-позиция; нетто-позиция; общий фондовый риск; специальный фондовый риск; общий процентный риск; специальный процентный риск; основной товарный риск; дополнительный товарный риск

##### Тема 5. Управление операционным риском

Сущность и принципы управления операционным риском. Причины возникновения операционного риска. Нарушения, приводящие к возникновению операционных убытков банка. Формы проявления операционных рисков. Операционные убытки. Формы проявления операционных рисков. Чистый процентный доход. Чистый непроцентный доход. Выявление операционного риска. Метод моделирования операционного риска

##### Тема 6. Внутренний контроль как элемент управления банковскими рисками

Сущность внутреннего контроля (аудита) в банковской деятельности. Принципы оценки системы внутреннего контроля. Базельские подходы к организации внутреннего контроля в банках Российской Федерации. Служба внутреннего контроля. Достоверность банковской отчетности. Наблюдение за банковскими рисками. Признание и оценка риска; мониторинг рисков.

##### Тема 7. Стресс-тестирование как элемент прогнозирования и управления рисками

Сущность и значение стресс-тестов. Виды шок-тестов. Факторы риска при стресс-тестировании. Шок-тестирование. Однофакторные стресс-тесты. Многофакторные стресс-тесты. Метод "Монте-Карло". Исторический сценарий. Гипотетический сценарий. Наихудший сценарий. Корреляция факторов. Алгоритм проведения стресс-тестирования.

#### 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)**

Официальный сайт справочно-правовой системы КонсультантПлюс - <https://consultant.ru>

Портал о банковском бизнесе Bankir.ru - <http://www.bankir.ru>

Электронно-библиотечная система Znanium.com - <https://znanium.com/catalog>

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

Вид работ	Методические рекомендации
лекции	Лекционный материал представлен в кратком объеме, достаточном для того, чтобы студент мог самостоятельно сориентироваться, проработать ключевые моменты и расширить объем информации с использованием основной и дополнительной литературы. В ходе очных и дистанционных лекционных занятий необходимо конспектировать излагаемый преподавателем материал. Учитывая необходимость самостоятельной работы, рекомендуется оставлять поля для своих пометок и дополнения конспекта лекций. Записи имеют важное значение для качественного усвоения материала курса. Они помогают выделить основные положения, проследить их логику и применить их в решении практических, ситуационных вопросов и задач. Кроме того, студент должен систематически вести записи для быстрого повторения прочитанного, для мобилизации накопленных знаний и успешной сдачи экзаменов/зачетов.
практические занятия	Практические задания предназначены для приобретения студентами практических навыков по изучаемой дисциплине. Примеры задач с ответами представлены на сайте института в разделе, содержащем контрольно-измерительные материалы кафедры. Студентам необходимо самостоятельно решить пример и сверить его с ответом. Контрольные работы содержат материал практических задач с измененными условиями. В целях успешного выполнения контрольных работ каждую практическую задачу необходимо самостоятельно разбирать, доводить до окончательного решения, а в случае затруднений обращаться к преподавателю.
самостоятельная работа	Вопросы для самостоятельной работы направлены на организацию более глубокой проработки темы, подготовки студентов к блиц-опросам, текущему и итоговому контролю. Рекомендуется придерживаться принципа 'Есть вопросы, будут знания!' и обращаться за консультацией к преподавателю. Для консультирования в рамках дистанционного обучения с использованием электронного образовательного ресурса предлагается пользоваться форумами и чатами на соответствующих площадках.
зачет	Для успешной сдачи зачета рекомендуется: - иметь при себе конспект лекций; - до очередного занятия проработать теоретический материал, соответствующий теме занятия; - в начале занятий задать преподавателю вопросы по материалу, вызвавшие затруднения в его понимании и освоении при решении задач, заданных для самостоятельного решения; - выполнять все плановые задания, выдаваемые преподавателем для самостоятельного выполнения, разбирать проблемные вопросы; - подготовку к зачету необходимо проводить по экзаменационным теоретическим и практическим вопросам.

## 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.

## 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 38.04.08 "Финансы и кредит" и магистерской программе "Финансовая аналитика".

Приложение 2  
к рабочей программе дисциплины (модуля)  
Б1.В.ДВ.05.02 Банковский риск-менеджмент

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

Направление подготовки: 38.04.08 - Финансы и кредит

Профиль подготовки: Финансовая аналитика

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очно-заочное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2025

**Основная литература:**

1. 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: 08.12.2023). - Режим доступа: по подписке.
2. Финансовые и банковские риски: учебник / Л. И. Юзович, Ю. Э. Слепухина, Ю. А. Долгих [и др.] ; под ред. Л. И. Юзович, Ю. Э. Слепухиной. - 2-е изд., стер. - Москва : ФЛИНТА ; Екатеринбург : Изд-во Урал. ун-та, 2022. - 336 с. - ISBN 978-5-9765-5066-7 (ФЛИНТА); ISBN 978-5-7996-3357-8 (Изд-во Урал. ун-та). - Текст: электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1900026> (дата обращения: 08.12.2023). - Режим доступа: по подписке.
3. Ковалев, П. П. Банковский риск-менеджмент: учебное пособие / П.П. Ковалев. - 2-е изд., перераб. и доп. - Москва: КУРС: ИНФРА-М, 2024. - 320 с. - ISBN 978-5-905554-36-0. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2109049> (дата обращения: 13.01.2024). - Режим доступа: по подписке.

**Дополнительная литература:**

1. Дубова, С.Е. Развитие рискориентированных подходов в банковском регулировании и надзоре : монография / С.Е. Дубова, А.С. Кутузова. - 3-е изд., стер. - Москва : ФЛИНТА, 2019. - 180 с. - ISBN 978-5-9765-1336-5. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1034933> (дата обращения: 08.12.2023). - Режим доступа: по подписке.
2. Мануйленко, В. В. Система оценки достаточности капитала коммерческого банка : монография / В. В. Мануйленко, Н. Н. Куницына. - Москва : Финансы и Статистика, 2021. - 319 с. - ISBN 978-5-00184-045-9. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1831437> (дата обращения: 08.12.2023). - Режим доступа: по подписке.
3. Москвин, В. А. Управление рисками при реализации инвестиционных проектов: рекомендации для предприятий и коммерческих банков : практическое руководство / В. А. Москвин. - Москва : Финансы и Статистика, 2021. - 352 с. - ISBN 978-5-00184-043-5. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1831409> (дата обращения: 08.12.2023). - Режим доступа: по подписке.
4. Попкова, Е. Г. Основы финансового мониторинга : учебное пособие / Е.Г. Попкова, О.Е. Акимова ; под ред. проф. Е.Г. Попковой. - Москва : ИНФРА-М, 2021. - 166 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс]. - (Высшее образование: Бакалавриат). - DOI 10.12737/2764. - ISBN 978-5-16-006839-8. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1361805> (дата обращения: 08.12.2023). - Режим доступа: по подписке.
5. Хасянова, С. Ю. Банковские риски: международные подходы к оценке и управлению : учебник / С.Ю. Хасянова. - Москва : ИНФРА-М, 2020. - 149 с. - (Высшее образование: Магистратура). - DOI 10.12737/1225278. - ISBN 978-5-16-109328-3. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1225278> (дата обращения: 08.12.2023). - Режим доступа: по подписке.
6. Прокопович, Д. А. Моделирование финансовых рисков : учебное пособие / Д. А. Прокопович, Н. Н. Савяк. - Красноярск : Сибирский федеральный университет, 2022. - 120 с. - ISBN 978-5-7638-4579-2. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/2093491> (дата обращения: 08.12.2023). - Режим доступа: по подписке.

*Приложение 3  
к рабочей программе дисциплины (модуля)  
Б1.В.ДВ.05.02 Банковский риск-менеджмент*

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

Направление подготовки: 38.04.08 - Финансы и кредит

Профиль подготовки: Финансовая аналитика

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очно-заочное

Язык обучения: русский

Год начала обучения по образовательной программе: 2025

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.