

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Саратовский государственный технический университет имени Гагарина Ю.А.»

Кафедра «Менеджмент и логистика»

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

по дисциплине

М.1.3.2.2 «Управление финансовыми рисками»

направления подготовки 38.04.02 «Менеджмент»
профиль «Деловое администрирование»

форма обучения – заочная

курс – 1

семестр – 2

зачетных единиц – 2

всего часов – 72

в том числе:

лекции – 4 (0,1 з.е.)

практические занятия – 10 (0,3 з.е.)

лабораторные занятия – нет

самостоятельная работа – 58 (1,6 з.е.)

переаттестация –

зачет – 2 семестр

экзамен – нет

РГР – нет

курсовая работа – нет

курсовой проект – нет

1. Цели и задачи дисциплины

Цель преподавания дисциплины: изучение особенностей финансовых рисков, а также экономических основ управления различными их видами для снижения финансовых потерь и обеспечения условий успешного функционирования компании.

Задачи преподавания дисциплины:

- детальное изучение сущности и видов финансовых рисков,
- выявление причин возникновения финансовых рисков;
- исследование сферы возникновения чистых и спекулятивных, в т.ч. финансовых рисков;
- освоение стратегических и тактических приемов управления различными видами рисков, а также возможности их сочетания.

2. Место дисциплины в структуре ООП ВО

Дисциплина «Управление финансовыми рисками» относится к вариативной части подготовки магистров ООП ВО по направлению 38.04.02 «Менеджмент» Магистерская программа «Деловое администрирование». Изучение дисциплины базируется на компетенциях, приобретенных при изучении дисциплин базовой части (М.1.1), вариативной части (М.1.2), дисциплин по выбору (М.1.3) в соответствии с ФГОС ВО по направлению 38.04.02 «Менеджмент». Особое значение придается предшествующему освоению дисциплин, «Финансовый менеджмент», «Современный стратегический анализ», «Корпоративные финансы».

3. Планируемые результаты освоения и обучения по дисциплине

Изучение дисциплины направлено на формирование следующих компетенций:

ОК-1 – способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу;

знать:

- виды финансовых рисков;

уметь:

- дифференцировать финансовые риски;

владеть:

- навыками выявления финансовых рисков.

ОК-2 – готовность действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения;

знать:

- квалификационную систему рисков;

уметь:

- принять решение по выбору приемов управления рисками в зависимости от вида;

владеть:

– навыками идентификации риска.

ОК-3 – готовность к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала;

знать:

– направления деятельности компании, при реализации которых возникают риски;

уметь:

– применить на практике методы управления финансовыми рисками;

владеть:

– навыками оценки финансовых рисков.

ОПК-1 – готовность к коммуникации в устной и письменной формах на русском и иностранном языках для решения задач профессиональной деятельности;

знать:

– систему информационного обеспечения управления финансовыми рисками;

уметь:

– осуществлять поиск информации необходимой для идентификации финансовых рисков;

владеть:

– навыками информационного обеспечения процессов управления финансовыми рисками.

ОПК-2 – готовность руководить коллективом в сфере своей профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия;

знать:

– субъекты, подвергающиеся экономическим рискам;

уметь:

– оценивать риски принятия организационных решений по управлению коллективом;

владеть:

– методами управления кредитными рисками с учетом межкультурных особенностей.

ОПК-3 – способность проводить самостоятельные исследования, обосновывать актуальность и практическую значимость избранной темы научного исследования;

знать:

– основные методы компенсации потерь от снижения покупательной способности денег;

уметь:

– проводить самостоятельные исследования по выявлению признаков экономического риска;

владеть:

– первичными навыками самостоятельной оценки экономического риска.

ПК-3 – способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач.

знать:

– современные методы риск-менеджмента;

уметь:

– выбрать соответствующий метод риск-менеджмента исходя из реализуемой стратегии организации;

владеть:

– навыками практической реализации методов риск-менеджмента.

4. Распределение трудоемкости (час.) дисциплины по темам и видам занятий

№ Мо-ду-ля	№ Нед-е-ли	№ Темы	Наименование темы	Часы				
				Всего	Лек-ции	Лабора-торные	Практ-ичес-кие	СРС
1 семестр								
		1	Риск как объект управления	12,5	0,5	-	2	10
		2	Управление инфляционным риском	14,5	0,5	-	2	12
		3	Управление валютным риском	15	1	-	2	12
		4	Управление кредитным риском	15	1	-	2	12
		5	Управление процентным риском	15	1	-	2	12
Всего				72	4	-	10	58

5. Содержание лекционного курса

№ темы	Всего часов	№ лекции	Тема лекции. Вопросы, отрабатываемые на лекции	Учебно-методическое обеспечение
1	0,5	1	Риск как объект управления 1. Риск как экономическая категория. Особенности риска. Три уровня субъектов, для которых возникает экономический риск. Классификация рисков по различным признакам. 2. Квалификационная система рисков. Категории, группы, виды, подвиды и разновидности рисков. Чистые и спекулятивные риски. Коммерческие и финансовые риски. Риски, связанные с покупательной способностью денег и инвестиционные риски. Систематические и несистематические риски. Направления деятельности компании, при реализации которых возникают риски.	1,2,3,4,18

№ темы	Всего часов	№ лекции	Тема лекции. Вопросы, отрабатываемые на лекции	Учебно-методическое обеспечение
2	0,5	1	<p>Управление инфляционным риском</p> <p>1. Явление инфляции и инфляционные процессы в экономике. Виды инфляции. Дефляция. Индекс инфляции. Темп инфляции. Понятие и сущность инфляционного риска. Основные методы компенсации потерь от снижения покупательной способности денег. Защитные оговорки.</p> <p>2. Виды товарно-ценовых оговорок. оговорки о скользящей цене, индексные оговорки. Индексация процентной ставки как способ управления инфляционным риском при выдаче кредитов. Величина наращенной суммы с учетом ее обесценения. Брутто-ставка и ее расчет.</p>	1,2,5,7,18
3	1	2	<p>Управление валютным риском</p> <p>1. Понятие валютного риска и его виды. Операционный, трансляционный и экономический валютные риски. Особенности управления трансляционным валютным риском. Защитные оговорки как метод страхования валютных рисков. Виды защитных оговорок. Золотая (прямая и косвенная), валютная и многовалютная оговорки.</p> <p>2. Компенсационные сделки. «Подушки». Компенсация и управление валютными операциями многонациональной компании. Иные методы управления валютными рисками на производственных предприятиях. Структурная балансировка, изменение срока платежа, параллельные ссуды, форфейтирование, самострахование, страхование, хеджирование.</p>	1,2,3,6,18
4	1	2	<p>Управление кредитным риском</p> <p>1. Понятие кредитного риска и его особенности. Дискуссионные вопросы о структуре кредитного риска. Оценка кредитного риска. Тактические методы управления кредитным риском. Гарантии правительства или банка. Страхование международных кредитов. Оценка кредитоспособности заемщика и эмитента как способ снижения кредитного риска.</p> <p>2. Система оценочных коэффициентов. Фундаментальный анализ эмитента и его бумаг. Формирование резерва на возможные потери по ссудам. Кредитные деривативы как способ управления кредитным риском. Понятие и виды кредитных деривативов. Форварды, свопы, опционы, индексные инструменты как представители семейства кредитных деривативов.</p>	1,2,7,4,18

№ темы	Всего часов	№ лекции	Тема лекции. Вопросы, отрабатываемые на лекции	Учебно-методическое обеспечение
5	1	3	<p>Управление процентным риском</p> <p>1. Понятие процентного риска и сфера его возникновения. Виды процентного риска: риск потерь от изменения потоков денежных средств, портфельный риск и экономический риск. Измерение процентного риска. Факторы, влияющие на процентный риск.</p> <p>2. Основные методы управления процентным риском и приемы их реализации. Метод длительности, нейтрализация требований и обязательств, метод эффективной границы, пассивные стратегии управления портфелем ценных бумаг, хеджирование.</p>	1,2,4,7,18

6. Содержание коллоквиумов

№ темы	Всего часов	№ коллоквиума	Тема коллоквиума. Вопросы, отрабатываемые на коллоквиуме	Учебно-методическое обеспечение
1	2	3	4	5

7. Перечень практических занятий

№ темы	Всего часов	№ занятия	Тема практического занятия. Задания, вопросы, отрабатываемые на практическом занятии	Учебно-методическое обеспечение
1	2	1	<p>Риск как объект управления</p> <p>1. Понятие риска и признаки экономического риска</p> <p>2. Квалификационная система рисков</p> <p>3. Систематические и несистематические риски.</p> <p>4. Субъекты, подвергающиеся экономическим рискам Решение задач выявления рисков</p>	1,2,3,4,19
2	2	2	<p>Управление инфляционным риском</p> <p>1. Инфляционные процессы в экономике. Виды инфляции.</p> <p>2. Основные стратегические и тактические методы управления инфляционным риском</p> <p>3. Решение задач по теме</p>	1,2,5,7,19
3	2	3	<p>Управление валютным риском</p> <p>1. Понятие валютного риска и его виды.</p> <p>2. Методы управления трансляционным валютным риском</p> <p>3. Стратегические и тактические методы управления операционным и экономическим валютными рисками</p> <p>4. Решение задач по теме</p>	1,2,3,6,19
4	2	4	Управление кредитным риском	1,2,7,4,19

№ темы	Всего часов	№ занятия	Тема практического занятия. Задания, вопросы, отрабатываемые на практическом занятии	Учебно-методическое обеспечение
			<ol style="list-style-type: none"> 1. Дискуссионные вопросы о структуре кредитного риска. 2. Оценка кредитного риска. 3. Стратегические и тактические методы управления кредитным риском на предприятиях и в банках 4. Решение задач по теме 	
5	2	5	<p>Управление процентным риском</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Виды процентного риска и факторы его вызывающие 2. Показатели оценки процентных рисков 3. Стратегические и тактические методы управления процентным риском на предприятиях и в банках 4. Решение задач по теме 	1,2,4,7,19

8. Перечень лабораторных работ

№ темы	Всего часов	Наименование лабораторной работы. Задания, вопросы, отрабатываемые на лабораторном занятии	Учебно-методическое обеспечение
1	2	4	3

9. Задания для самостоятельной работы студентов

№ темы	Всего Часов	Задания, вопросы, для самостоятельного изучения (задания)	Учебно-методическое обеспечение
1	2	3	4
1	10	<ol style="list-style-type: none"> 1. Работа с конспектами лекций; 2. Ответы на контрольные вопросы 	1,2,3,4,20
2	12	<ol style="list-style-type: none"> 1. Решение задач, в т.ч. Комплексных электронных; 2. Ответы на контрольные вопросы; 3. Работа со словарями и справочниками. 	1,2,5,7,20
3	12	<ol style="list-style-type: none"> 1. Решение задач, в т.ч. Комплексных электронных; 2. Ответы на контрольные вопросы; 	1,2,3,6,20
4	12	<ol style="list-style-type: none"> 1. Решение задач, в т.ч. Комплексных электронных; 2. Ответы на контрольные вопросы; 	1,2,7,4,20
5	12	<ol style="list-style-type: none"> 1. Решение задач, в т.ч. Комплексных электронных; 2. Ответы на контрольные вопросы; 3. Работа со словарями и справочниками. 	1,2,4,7,20

10. Расчетно-графическая работа

Не предусмотрена учебным планом

11. Курсовая работа

Не предусмотрена учебным планом

12. Курсовой проект

Не предусмотрен учебным планом

13. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине предусматривает контроль за освоением профессиональных компетенций:

ОК-1 – способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу;

ОК-2 – готовность действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения;

ОК-3 – готовность к саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала;

ОПК-1 – готовность к коммуникации в устной и письменной формах на русском и иностранном языках для решения задач профессиональной деятельности;

ОПК-2 – готовность руководить коллективом в сфере своей профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия;

ОПК-3 – способность проводить самостоятельные исследования, обосновывать актуальность и практическую значимость избранной темы научного исследования;

ПК-3 – способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач.

Компетенции считаются сформированными на:

– пороговом уровне – оценка «удовлетворительно» (зачтено);

– продвинутом уровне – оценка «хорошо»;

– высоком уровне – оценка «отлично»;

если магистрант выполнил все практические задания, СРС, прошел промежуточную аттестацию и получил положительную оценку на экзамене (зачете).

Уровни и этапы формирования компетенций утверждены в составе Паспорта компетенций по направлению подготовки 38.04.02 «Менеджмент» (профиль «Деловое администрирование») протоколом УМКН № 3 от 1 октября 2015 г.

Средства и технологии оценки:

знаний	С помощью тестирования, устных опросов
умений	С помощью выполнения заданий, задач по
владений	заданному алгоритму

Фонд оценочных средств (Приложение к рабочей программе; Задания / Контрольные материалы / Информационно-образовательная среда СГТУ имени Гагарина Ю.А. – Режим доступа: <https://portal3.sstu.ru/Facult/IRBIS/ML/38.04.02-oz/M.1.3.2.2/default.aspx>)

включает в себя:

- комплект тестовых заданий для текущего контроля;
- тестовые задания для итогового контроля освоения дисциплины;
- задачи, задания творческого характера;
- комплект тематик для дискуссий
- вопросы для подготовки к экзамену/зачету.

Паспорт фонда оценочных средств

№ п/п	Контролируемые блоки (темы) дисциплины	Контролируемые компетенции (или их части)**	Наименование оценочного средства
1	Риск как объект управления	ОК-1, ОК-2, ОК-3, ОПК-1, ОПК-2, ОПК-3, ПК-3	Комплект тестовых заданий Комплект КС Комплект задач п.20 р.15
2	Управление инфляционным риском	ОК-1, ОК-2, ОК-3, ОПК-1, ОПК-2, ОПК-3, ПК-3	Комплект тестовых заданий Комплект КС Комплект задач п.20 р.15
3	Управление валютным риском	ОК-1, ОК-2, ОК-3, ОПК-1, ОПК-2, ОПК-3, ПК-3	Комплект тестовых заданий Комплект КС Комплект задач п.20 р.15
4	Управление кредитным риском	ОК-1, ОК-2, ОК-3, ОПК-1, ОПК-2, ОПК-3, ПК-3	Комплект тестовых заданий Комплект КС Комплект задач п.20 р.15
5	Управление процентным риском	ОК-1, ОК-2, ОК-3, ОПК-1, ОПК-2, ОПК-3, ПК-3	Комплект тестовых заданий Комплект КС Комплект задач п.20 р.15

Вопросы для зачета

1. Понятие риска и его особенности как экономической категории
2. Уровни субъектов, для которых возникает экономический риск
3. Взаимосвязь категорий риск и доходность
4. Взаимосвязь понятий «риск» и «убытки»
5. Классификация рисков в зависимости от возможного результата, от основной причины возникновения
6. Квалификационная система рисков
7. Краткая характеристика финансовых рисков
8. Риски, возникающие при осуществлении таможенной деятельности
9. Риски, возникающие при проведении экспортно-импортных операций
10. Краткая характеристика коммерческих рисков
11. Сущность процесса управления рисками
12. Этапы управления рисками. Функции риск-менеджера на каждом этапе
13. Направления деятельности компании, при осуществлении которых возникают риски
14. Понятие и виды убытков
15. Классы убытков
16. Максимально возможный и максимально вероятный риск. Значение их оценки
17. Суть метода избежания убытков
18. Суть метода принятия рисков на себя
19. Суть метода предотвращения убытков
20. Суть метода уменьшения размера убытков
21. Суть метода страхования
22. Суть метода самострахования
23. Суть метода хеджирования
24. Методы передачи риска и их содержание
25. Пересмотр программ управления рисками
26. Основные подходы к оценке риска
27. Метод построения дерева вероятностей
28. Исходная, условная и совместная вероятности. Методы их подсчета
29. Критерии измерения величины (степени) риска
30. Недостатки показателя ковариации, влияющие на точность оценки величины риска
31. Характеристика коэффициента вариации и качественная оценка его значений
32. Характеристика процесса инфляции и оценка уровня цен. Понятие инфляционного риска
33. Методы управления инфляционным риском

34. Понятие и виды валютного риска
35. Управление трансляционным валютным риском
36. Защитные оговорки как метод управления валютным риском. Виды валютных оговорок
37. Преимущества многовалютной оговорки по сравнению с одновалютной оговоркой
38. Виды валютных корзин (валютных «коктейлей»)
39. Суть методики «компенсация»
40. «Подушки» способ устранения валютного риска. Риски, возникающие при использовании «подушки»
41. Понятие кредитного риска и сфера его возникновения
42. Основные способы защиты от кредитных рисков
43. Порядок формирования и использования резерва на возможные потери по ссудам в коммерческом банке
44. Принципы ликвидности и рычаги воздействия со стороны государственных органов по их обязательному соблюдению
45. Кредитные деривативы: понятие, виды и их использование для управления кредитным риском
46. Понятие и виды процентного риска. Сферы его возникновения
47. Особенности управления процентным риском в коммерческом банке
48. Понятие хеджирования
49. Сущность и виды форвардных контрактов
50. Понятие и виды фьючерсных контрактов
51. Особенности опционных контрактов и их классификация
52. Виды хеджирования и техника проведения операций с различными инструментами
53. Особенности хеджирования валютного риска. Используемые инструменты
54. Особенности хеджирования процентного риска. Используемые инструменты
55. Свопы как инструменты передачи риска

Критерии оценки проведения контроля по проверке базовых знаний по дисциплине

<i>Оценка</i>	<i>Критерии оценки</i>
Зачтено	Студент полностью раскрывает содержание вопроса, может проиллюстрировать те или иные аспекты ответа, применяет знания смежных дисциплин
	Студент частично раскрывает содержание вопроса, не всегда может проиллюстрировать те или иные аспекты ответа, не всегда применяет знания смежных дисциплин

	Студент раскрывает содержание вопроса, не может проиллюстрировать те или иные аспекты ответа, не применяет знания смежных дисциплин
Незачтено	Студент не раскрывает содержание вопроса

Вопросы для экзамена
Не предусмотрен учебным планом

Тестовые задания по дисциплине (примерные)

Комплект тестовых заданий состоит из таких типов, как:

- выбор одного варианта ответа из предложенного множества,
- выбор нескольких верных вариантов ответа из предложенного множества,
- задания на установление соответствия,
- задание на установление правильной последовательности,
- задание на заполнение пропущенного ключевого слова.

1. Основным принципом управления фондовым портфелем предприятия является:

- а) диверсификация структуры портфеля;
- б) максимизация) $T_j/F1+1$ доходности портфеля;
- в) максимизация надежности портфеля.

2. Кредитные риски характерны для деятельности:

- а) только лицензированных банков;
- б) любых банков и небанковских институтов;
- в) любых предприятий.

3. Наиболее распространенным вариантом стратегии управления финансовыми рисками предприятия выступает:

- а) высокорисковая стратегия;
- б) стратегия диверсификация рисков;
- в) стратегия минимизация рисков.

4. Наиболее опасной формой потерь от наступивших рисков выступают:

- а) дополнительные затраты;
- б) прямой ущерб;
- в) упущенная выгода.

5. Наиболее распространенным методом профилактики финансовых рисков предприятия выступает:

- а) диверсификация рисков по группам клиентов;

- б) диверсификация рисков по видам операций;
- в) эффективный маркетинг.

6. Наиболее распространенным методом компенсации потерь от наступивших финансовых рисков предприятия выступает:

- а) создание собственного финансового резерва;
- б) страхование финансовых рисков;
- в) использование заемных средств.

7. Наиболее эффективным методом противодействия финансовым рискам предприятия выступает:

- а) их профилактика;
- б) наименее затратная компенсация возможных потерь;
- в) полный отказ от рискованных операций.

8. Основными источниками собственного капитала являются средства)

- а) полученные от эмиссии акций;
- б) полученные в результате выпуска облигаций.

9. Портфель роста:

- а) служат получению высоких текущих доходов;
- б) состоят из акций, курс растет;
- в) включают ценные бумаги молодых компаний.

10. Риск ликвидности портфеля ценных бумаг:

а) обусловлен возможностью потерь при реализации ценных бумаг из-за изменения их качества;

б) эмитент долговых ценных бумаг не в состоянии выплачивать проценты по ним или основную сумму долга;

в) риск неправильного выбора ценных бумаг для инвестирования.

11. К производным ценным бумагам относятся;

- а) казначейские обязательства;
- б) опционы;
- в) акции;
- с) облигации.

12. Коэффициент Бета есть:

а) мера вклада индивидуальной ценной бумаги в суммарный риск рыночного портфеля;

б) мера недиверсифицируемого компонента риска;

в) отношение ковариации между доходом индивидуальной ценной бумаги и доходом рыночного портфеля к дисперсии рыночного портфеля;

г) все вышеперечисленное.

13. Риск, который может быть устранен правильным подбором инвестиций, называется:

- а) корреляционным;
- б) системным;
- в) диверсифицируемым;
- г) включает все вышеперечисленные характеристики.

14. Суммарный риск инвестиционного портфеля:

- а) равен сумме системного и диверсифицируемого рисков;
- б) может быть полностью устранен путем правильного подбора инвестиций;
- в) снижается путем подбора составляющих инвестиционного портфеля, имеющих позитивную корреляцию;
- г) все вышеперечисленное.

15. Диверсификация инвестиционного портфеля – это:

- а) процесс рассредоточения средств по инвестициям в целях сокращения риска;
- б) процесс, направленный на снижение риска по основному инвестиционному проекту;
- в) процесс замены инструментов с падающей доходностью на инструменты с растущей доходностью;
- г) поиск ценных бумаг, имеющих позитивную корреляцию.

Критерии оценки тестовых заданий (в баллах):

- 5 баллов выставляется студенту, если выполнено 75-100% заданий;
- 4 балла выставляется студенту, если выполнено 50- 75% заданий;
- 3 балла выставляется студенту, если выполнено 25-50% заданий;
- 2 балла выставляется студенту, если выполнено менее 25% заданий.

14. Образовательные технологии

При изучении дисциплины «Управление финансовыми рисками» используются следующие образовательные технологии:

- 1) дистанционные образовательные технологии на основе использования Информационно-образовательной среды СГТУ имени Гагарина Ю.А., направленные на организацию самостоятельной работы обучающихся, и позволяющие осуществлять дистанционное консультирование студентов;
- 2) лично-ориентированные образовательные технологии, направленные на самостоятельное приобретение знаний и их применение (дискуссии, беседы, самостоятельная деятельность);
- 3) проблемно-развивающие образовательные технологии, направленные на формирование творческой личности, обладающей исследовательской активностью и самостоятельностью

15. ПЕРЕЧЕНЬ УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

ОСНОВНАЯ ЛИТЕРАТУРА

1. Цику Б.Х. Современные проблемы и технологии финансового менеджмента [Электронный ресурс]: конспект лекций для магистрантов направления подготовки 080100 - Экономика, магистерской программы «Экономическая теория и финансово-кредитные отношения». Учебное пособие/ Цику Б.Х., Кушу С.О.— Электрон. текстовые данные.— Краснодар: Южный институт менеджмента, 2013.— 76 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/25984>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
2. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций [Электронный ресурс] / Шапкин А. С. - М. : Дашков и К, 2013. - <http://www.studentlibrary.ru/book/ISBN9785394021503.html>
3. Финансовый менеджмент: теория и практика [Электронный ресурс] / В.В. Ковалев. - 3-е изд., пере-раб. и доп - М. : Проспект, 2014. - <http://www.studentlibrary.ru/book/ISBN9785392112357.html>

ДОПОЛНИТЕЛЬНАЯ ЛИТЕРАТУРА

4. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах [Электронный ресурс] / Новиков А. И. - М. : Дашков и К, 2013. - <http://www.studentlibrary.ru/book/ISBN9785394013805.html>
5. Финансовый менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Т.В. Абалакина [и др.].— Электрон. текстовые данные.— М.: ИД «Экономическая газета», ИТКОР, 2011.— 518 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/8383>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
6. Шапкин А.С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций [Электронный ресурс]: учебник/ Шапкин А.С., Шапкин В.А.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 880 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/52275>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
7. Фирсова О.А. Управление рисками организаций [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие/ Фирсова О.А.— Электрон. текстовые данные.— Орел: Межрегиональная Академия безопасности и выживания (МАБИБ), 2014.— 82 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/33447>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
8. Никулина Н.Н. Финансовый менеджмент организации. Теория и практика [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Никулина Н.Н., Суходоев Д.В., Эриашвили Н.Д.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012.— 511 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10515>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю
9. Финансовый менеджмент государственных программ [Электронный ресурс]: учебное пособие/ А.Я. Быстряков [и др.].— Электрон. текстовые данные.— М.: Российский университет дружбы народов, 2013.—

80 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/22228>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю

10. Турманидзе Т.У. Финансовый менеджмент [Электронный ресурс]: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям/ Турманидзе Т.У., Эриашвили Н.Д.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2015.— 247 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/34529>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю

ПЕРИОДИЧЕСКИЕ ИЗДАНИЯ

11. Финансы : теорет. и науч.-практ. журнал. - М. : ООО "Книжная редакция "Финансы", 1926 - . - Выходит ежемесячно (2011-2016), № 1-12.

12. Финансовые исследования. – Режим доступа: <http://elibrary.ru/contents.asp?titleid=10488>

13. Управление риском : аналит. журн. - М. : ООО "Анкил". - Выходит ежеквартально. - ISSN 1684-6303 (2011-2015), № 1-4.

14. Деньги и кредит. – Режим доступа <http://elibrary.ru/contents.asp?titleid=8647>

ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННАЯ СЕТЬ «ИНТЕРНЕТ»

ИНТЕРНЕТ-РЕСУРСЫ

12. Иванов, А. А. Риск-менеджмент. Учебно-методический комплекс [Электронный ресурс] / А. А. Иванов, С. Я. Олейников, С. А. Бочаров. - М.: Евразийский открытый институт, 2011. - 303 с. - 978-5-374-00013-6. – Режим доступа: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=93140>

13. Новиков, А. И. Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах. Учебное пособие для бакалавров [Электронный ресурс] / А. И. Новиков, Т. И. Солодкая. - М.: Дашков и Ко, 2013. - 285 с. - 978-5-394-01380-5. – Режим доступа: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=116497>

14. Официальный сайт ОАО «Фондовая биржа «РТС». – Режим доступа: <http://www.rts.ru>

15. Официальный сайт Министерства финансов РФ. – Режим доступа: <http://www.minfin.ru>

16. Официальный сайт Росстата. – Режим доступа: <http://www.gks.ru> –

17. Портал «Корпоративный менеджмент». – Режим доступа: <http://www.cfin.ru>

ИСТОЧНИКИ ИНФОРМАЦИОННО-ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ СРЕДЫ СГТУ ИМЕНИ ГАГАРИНА Ю.А.

18. Лекции [Электронный ресурс] / Учебные материалы // ИОС СГТУ имени Гагарина Ю.А. – Режим доступа: <https://portal3.sstu.ru/Facult/IRBIS/ML/38.04.02-oz/M.1.3.2.2/default.aspx>

19. Методические указания по проведению практических занятий [Электронный ресурс] / Учебно-методические материалы // ИОС СГТУ имени Гагарина Ю.А. – Режим доступа: <https://portal3.sstu.ru/Facult/IRBIS/ML/38.04.02-oz/M.1.3.2.2/default.aspx>

20. Методические указания по проведению СРС [Электронный ресурс] / Учебно-методические материалы // ИОС СГТУ имени Гагарина Ю.А. – Режим доступа: <https://portal3.sstu.ru/Facult/IRBIS/ML/38.04.02-oz/M.1.3.2.2/default.aspx>

16. Информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса по дисциплине и материально-техническое обеспечение

Для реализации образовательной деятельности по дисциплине «Управление финансовыми рисками» учебного плана направления подготовки 38.04.02 «Менеджмент» магистерская программа «Деловое администрирование» имеются:

– аудитории со стандартным оснащением для проведения лекционных занятий площадью не менее 40 м² на группу студентов, оснащенные доской; экраном; видеопроекционным оборудованием; средствами звуковоспроизведения; ПЭВМ с выходом в сеть Интернет; наглядными пособиями;

– аудитории со стандартным оснащением для проведения семинарских и практических занятий площадью не менее 20 м² на группу студентов, оснащенные доской, учебной мебелью (столами, стульями); наглядными пособиями;

– компьютерный класс площадью не менее 30 м² на группу студентов оснащенный ПЭВМ, имеющими возможность выхода в: Интернет; Электронную библиотечную систему Научно-технической библиотеки СГТУ имени Гагарина Ю.А.; Информационно-образовательную среду СГТУ;

– программное обеспечение: Microsoft Windows 7 professional; Microsoft Windows XP professional; Microsoft Office professional plus 2000; 1С: Предприятие 8.3.