

**Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

ИНСТИТУТ ОБЩЕСТВЕННЫХ НАУК
(наименование института (факультета))
Кафедра дизайна
(наименование кафедры)

УТВЕРЖДЕНА
на заседании кафедры дизайна
Протокол №1 от 29.08.2017 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.В.ДВ.03.02 Риск-менеджмент

38.04.02 Менеджмент
(код и наименование направления подготовки)

" Управление в Арт-бизнесе"
направленность (профиль)

Магистр
квалификация

очная
форма обучения

Год набора - 2017

Москва, 2017 г.

Автор–составитель:

Доцент, кандидат физико-математических наук

Иванов О.В.

Заведующий кафедрой дизайна,
Профессор, кандидат искусствоведения

Серов С.И.

Содержание

| | |
|------|---|
| | Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы..... |
| 1. | соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы..... |
| 2. | Объем и место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы..... |
| 3. | Содержание и структура дисциплины (модуля)..... |
| 4. | Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)..... |
| 5. | Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)..... |
| 6. | Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)..... |
| 6.1. | Основная литература..... |
| 6.2. | Дополнительная литература..... |
| 6.3. | Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы..... |
| 6.4. | Нормативные правовые документы..... |
| 6.5. | Интернет-ресурсы..... |
| 6.6. | Иные источники..... |
| 7. | Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы |

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы

1.1. Дисциплина Б1.В.ДВ.03.02 «Риск-менеджмент» обеспечивает овладение следующими компетенциями с учетом этапа :

| Код компетенции | Наименование компетенции | Код этапа освоения компетенции | Наименование этапа освоения компетенции |
|-----------------|--|--------------------------------|--|
| ПК-3 | Способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач | ПК-3.2 | Способность применять современные методы управления корпоративными финансами |

1.2. В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

| ОТФ/ТФ1 (при наличии профстандарта)/ трудовые или профессиональные действия | Код этапа освоения компетенции | Результаты обучения |
|--|--------------------------------|---|
| <p>А. Разработка отдельных направлений риск-менеджмента</p> <p>А/01.6 Определение контекста, идентификация, анализ рисков и выработка мероприятий по воздействию на риск</p> <p>А/04.6 Разработка методической и нормативной базы системы управления рисками и принципов управления рисками в рамках отдельных бизнес-процессов, направлений</p> | ПК-3.2 | На уровне знаний: знать цели и задачи риск-менеджмента, особенности различных видов рисков и методы управления ими; классификацию различных факторов риска и способы их анализа, технологии оценки факторов риска; знать методы управления рисками на уровне компании |
| | | На уровне умений: выявлять различные факторы риска и оценивать величину подверженности им; выявлять различные факторы риска; оценивать различные факторы риска, умение анализировать и оценивать корпоративные риски на уровне компании в целом; |
| | | На уровне навыков: практического управления рисками с использованием современных инструментов их оценки и управления; выявления факторов риска, оценки различных факторов риска; риск-менеджмента на уровне компании в целом |

2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 зачётных единицы (72 академических часа/54 астрономических часа). На контактную работу с преподавателем выделяется 48/36 часов, на самостоятельную работу обучающихся выделяется 24/18 часов.

¹ Для образовательных программ, реализуемых по ФГОС, и для универсальных компетенций первая колонка может не заполняться

Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина «Риск-менеджмент» относится к дисциплинам вариативной части учебного плана. Код дисциплины Б1.В.ДВ.03.02 Дисциплина изучается на 2 курсе в 3 семестре.

Дисциплина базируется на знаниях, полученных в ходе изучения «Теории менеджмента», «Инновации в сфере культуры», «Управление в сфере экспертизы произведений искусства», является основой для изучения дисциплин: Методы исследований в менеджменте, Технологии выполнения выпускной квалификационной работы, прохождения производственной практики, выполнения научно-исследовательской работы и написания выпускной квалификационной работы.

3. Содержание и структура дисциплины

Таблица 1.

| № п/п | Наименование тем (разделов) | Объем дисциплины (модуля), час. | | | | Форма текущего контроля успеваемости, промежуточно й аттестации |
|--------------------------|---|---------------------------------|---|----|----|---|
| | | Всего | Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий | | СР | |
| | | | Л | ПЗ | | |
| Тема 1 | Понятие предпринимательского риска | 13 | | 9 | 4 | Д |
| Тема 2 | Выявление факторов риска. Идентификация факторов риска | 13 | | 9 | 4 | Д |
| Тема 3 | Построение многофакторной модели. Теория арбитражного ценообразования. Параметрический метод оценки VaR | 13 | | 9 | 4 | О, ПР |
| Тема 4 | Оценка меры ожидаемого дефицита ES в предположении нормальности распределения | 13 | | 9 | 4 | О, Д |
| Тема 5 | Стратегии хеджирования. Коэффициент хеджирования. Эффективность хеджирования | 20 | | 12 | 8 | ПР |
| Промежуточная аттестация | | | | | | Зачет |
| Всего: | | 72 | | 48 | 24 | |

Содержание дисциплины

Тема 1. Понятие предпринимательского риска

Риск, как один из отличительных признаков предпринимательской деятельности. Неопределенность, связанная со средой, в которой принимается решение и риск. Причины и факторы риска. Концепция приемлемого риска и идея управления риском. Различные уровни риска при управлении им и движение к приемлемому уровню. Этапы реализации концепции приемлемого риска.

Тема 2. Выявление факторов риска. Идентификация факторов риска

Внешние и внутренние факторы риска и их классификация. Финансовая отчетность компании, как один из основных источников информации о факторах риска. Использование финансовой отчетности для выявления факторов риска.

Тема 3. Построение многофакторной модели. Теория арбитражного ценообразования. Параметрический метод оценки VaR

Многофакторная модель и предположения, положенные в ее основу. Различные представления многофакторной модели. Теория арбитражного ценообразования и ее связь с многофакторной моделью. Модель VaR и предположения, лежащие в ее основе. Базельский вариант модели VaR. Применение методов статистического моделирования (Монте – Карло) для оценки величины VaR без предположения о логнормальности.

Тема 4. Оценка меры ожидаемого дефицита ES в предположении нормальности распределения

Определение меры ожидаемого дефицита ES и сравнения ее с VaR. Свойства ES. Формула оценки меры ожидаемого дефицита ES в предположении нормальности распределения. Особенности оценки меры ожидаемого дефицита ES методом Монте Карло. Ценообразование фьючерсных контрактов с помощью модели «cash-and-carry». Ценообразование опционов, формула Блэка—Шоулза. Арбитражные операции

Тема 5. Стратегии хеджирования. Коэффициент хеджирования. Эффективность хеджирования

Спрэды, стрэнглы и стрэддлы и стратегии хеджирования с их использованием. Совершенное хеджирование и частичное хеджирование. Коэффициент хеджирования. Оценка коэффициента хеджирования с помощью линейной регрессии. Хеджирование с минимальной дисперсией. Коэффициент хеджирования с минимальной дисперсией. Использование коэффициента детерминации для определения степени эффективности хеджирования.

4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине

4.1. Формы и методы текущего контроля успеваемости обучающихся и промежуточной аттестации.

4.1.1. В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.03.02 «Риск-менеджмент» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

- при проведении занятий лекционного и семинарского типа: опрос (О);
- при проведении занятий практического типа: практические задания (ПЗ), контрольная работа (КР).

4.1.2. Зачет проводится с применением следующих методов - выполнение контрольных расчетных задач

4.2. Материалы текущего контроля успеваемости.

Типовые оценочные материалы по теме 1.

1. Риск, как один из отличительных признаков предпринимательской деятельности. Неопределенность, связанная со средой, в которой принимается решение и риск. Причины и факторы риска.

2. Концепция приемлемого риска и идея управления риском. Различные уровни риска при управлении им и движение к приемлемому уровню. Этапы реализации концепции приемлемого риска.

3. Цель и задачи риск-менеджмента

Типовые оценочные материалы по теме 2.

1. Финансовая отчетность компании, как один из основных источников информации о факторах риска. Использование финансовой отчетности для выявления факторов риска.

2. Внешняя доступная информация, как источник идентификации рисков.

3. Многофакторная модель и ее применения.

4. Теория арбитражного ценообразования, ее связь с многофакторной моделью и применения.

Типовые оценочные материалы по теме 3.

1. Дельта – нормальная модель VaR и возможности ее применения.

2. Методы статистического моделирования (Монте – Карло) для оценки величины VaR без предположения о логнормальности.

3. Дельта- нормальный метод оценки меры ожидаемого дефицита ES и сравнение ее с VaR.

4. Особенности оценки меры ожидаемого дефицита ES методом Монте Карло без предположения о логнормальности.

Типовые оценочные материалы по теме 4.

Вопросы для обсуждения

1. Ценообразование фьючерсных контрактов с помощью модели «cash-and-carry».

2. Ценообразование опционов, формула Блэка—Шоулза.

3. Арбитражные операции.

4. Дельта хеджирование. Дельта-гамма хеджирование.

Типовые оценочные материалы по теме 5.

1. Совершенное хеджирование и частичное хеджирование.

2. Коэффициент хеджирования. Оценка коэффициента хеджирования с помощью линейной регрессии.

3. Хеджирование с минимальной дисперсией. Коэффициент хеджирования с минимальной дисперсией.

4. Использование коэффициента детерминации для определения степени эффективности хеджирования.

4.3. Оценочные средства для промежуточной аттестации

4.3.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы. Показатели и критерии оценивания компетенций с учетом этапа их формирования

| Код компетенции | Наименование компетенции | Код этапа освоения компетенции | Наименование этапа освоения компетенции |
|-----------------|--|--------------------------------|--|
| ПК-3 | Способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач | ПК-3.2 | Способность применять современные методы управления корпоративными финансами |

| Этап освоения компетенции | Показатель оценивания | Критерий оценивания |
|--|---|--|
| ПК-3.2 Способность применять современные методы управления корпоративными финансами | Способен провести оценку современных методов управления корпоративными финансами; Демонстрирует умения определять перспективы развития корпорации; Демонстрирует умения определять потребности и обеспеченность в финансовых ресурсах; Способен составить прогноз финансовой устойчивости корпорации | Проведена оценка современных методов управления корпоративными финансами; Определена перспектива развития корпорации; Рассчитаны потребности и обеспеченность в финансовых ресурсах; Составлен прогноз финансовой устойчивости корпорации |

4.3.2. Типовые оценочные средства.

Список вопросов для подготовки к зачету:

1. Понятие предпринимательского риска.
 2. Концепция приемлемого риска.
 3. Цель и задачи риск – менеджмента.
 4. Построение многофакторной модели.
 5. Многофакторная модель и теория арбитражного ценообразования.
 6. Управление рисками с помощью моделей VaR.
 7. Параметрическая модель VaR.
 8. Мера ожидаемого дефицита ES и ее применение.
 9. Оценка VaR по методу Монте Карло.
 10. Оценка ES по методу Монте Карло.
 11. Ценообразование фьючерсных контрактов с помощью модели «cash-and-carry».
- Применение для проведения арбитражных операций.
12. Ценообразование опционов. Формула Блэка—Шоулза. Применение для проведения арбитражных операций.
 13. Коэффициент хеджирования, его смысл и применение при управлении рисками.
 14. Спрэды и их применение при управлении рисками.
 15. Стрэнглы и их применение при управлении рисками.
 16. Стрэддлы и их применение при управлении рисками.

Типовой вариант контрольной работы по зачету.

1. Описать многофакторную модель, способ ее построения и возможности и способы ее применения в риск-менеджменте.
2. Мера риска VaR, ее смысл. Можно ли применять на практике дельта-нормальную модель оценки VaR и когда?
3. Чему равен коэффициент хеджирования при хеджировании базовой позиции позицией в фьючерсных контрактах? В чем смысл коэффициента хеджирования и его применения на практике?
4. Предположим, что вы вице- президент по финансам в Hotels International и покупаете большое количество кофе каждый месяц. Вас волнует, какой будет цена кофе через месяц. Вы хотите получить гарантию того, что через месяц не заплатите

больше 1.5 долл. за фунт, покупая 35000 фунтов. Вы не намерены страховать риск, но хотите получить гарантированную цену в 1.5 долл. за фунт при покупке 35000 фунтов кофе.

А). Объясните экономический механизм фьючерсной сделки, если спотовая цена на момент поставки составляет 1.25 долл., 1.5 долл. и 1.75 долл.

Б). Каковы варианты совокупных выплат при использовании фьючерсных контрактов?

В). Если на момент поставки кофе будет стоить 1.25 долл., должны ли вы сожалеть о заключении фьючерсного контракта?

Шкала оценивания

| Критерии оценки | Оценка |
|--|------------|
| <p>Демонстрирует знание методологии расчета статистических показателей и вопросы применения статистики в конкретных исследованиях социально-экономических процессах, теоретические основы и закономерности функционирования национальной экономики на макроуровне;</p> <p>Исследует показатели анализа коммерческой деятельности, включая методологию расчета показателей финансовой статистики, умеет анализировать, обобщать и систематизировать информацию о взаимосвязях между явлениями и процессами экономического характера на макроуровне</p> <p>Демонстрирует знание теоретико- методологических основ формирования современной налоговой политики и стратегии; знает основные способы разработки управленческих решений по формированию современной налоговой политики и стратегии; теоретико- методологические основы современного налогового администрирования.</p> <p>Применяет методы управленческих решений с использованием современных технических средств и информационных технологий в области формирования современной налоговой политики и стратегии, выбирает и обосновывает оптимальные инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, умеет анализировать результаты расчётов и обосновывать полученные выводы.</p> | Зачтено |
| <p>Не демонстрирует знание методологии расчета статистических показателей и вопросы применения статистики в конкретных исследованиях социально-экономических процессах, теоретические основы и закономерности функционирования национальной экономики на макроуровне;</p> <p>Не исследует показатели анализа коммерческой деятельности, включая методологию расчета показателей финансовой статистики, не умеет анализировать, обобщать и систематизировать информацию о взаимосвязях между явлениями и процессами экономического характера на макроуровне;</p> <p>Не демонстрирует знание теоретико- методологических основ формирования современной налоговой политики и стратегии; не знает основные способы разработки управленческих решений по формированию современной налоговой политики и стратегии; теоретико- методологические основы современного налогового администрирования.</p> <p>Не применяет методы управленческих решений с использованием современных технических средств и информационных технологий в области формирования современной налоговой политики и стратегии, не выбирает и не обосновывает оптимальные инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной</p> | Не зачтено |

| | |
|---|--|
| задачей, не умеет анализировать результаты расчётов и обосновывать полученные выводы. | |
|---|--|

1.4. Методические материалы

Промежуточная аттестация (зачет) по дисциплине проходит в форме тестирования. Студенты одновременно решают тестовые задания. Каждый студент получает свой персональный вариант теста. Каждый тест состоит из 16 вопросов закрытого типа. На организационную подготовку отводится от 20 до 30 минут, на написание теста – 90 минут. Во время организационной подготовки студентам разъясняются правила проведения зачета и выдаются бланки ответов для заполнения. Каждый студент вытаскивает билет с тестовым заданием. После проведения зачета проводится проверка работ.

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Требования к организации самостоятельной работы студентов при подготовке к аудиторным занятиям

Подготовка к семинарским занятиям.

Подготовку к каждому семинарскому занятию каждый студент должен начать с ознакомления с планом семинарского занятия, который отражает содержание предложенной темы. Тщательное продумывание и изучение вопросов плана основывается на проработке текущего материала лекции, а затем изучения обязательной и дополнительной литературы, рекомендованную к данной теме. На основе индивидуальных предпочтений студенту необходимо самостоятельно выбрать тему доклада по проблеме семинара и по возможности подготовить по нему презентацию. Если программой дисциплины предусмотрено выполнение практического задания, то его необходимо выполнить с учетом предложенной инструкции (устно или 10 письменно). Все новые понятия по изучаемой теме необходимо выучить наизусть и внести в глоссарий, который целесообразно вести с самого начала изучения курса. Результат такой работы должен проявиться в способности студента свободно ответить на теоретические вопросы семинара, его выступлении и участии в коллективном обсуждении вопросов изучаемой темы, правильном выполнении практических заданий и контрольных работ. Структура семинара В зависимости от содержания и количества отведенного времени на изучение каждой темы семинарское занятие может состоять из четырех-пяти частей:

1. Обсуждение теоретических вопросов, определенных программой дисциплины.
2. Доклад и/ или выступление с презентациями по проблеме семинара.
3. Обсуждение выступлений по теме – дискуссия.
4. Выполнение практического задания с последующим разбором полученных результатов или обсуждение практического задания, выполненного дома, если это предусмотрено программой.
5. Подведение итогов занятия.

Первая часть – обсуждение теоретических вопросов - проводится в виде фронтальной беседы со всей группой и включает выборочную проверку преподавателем теоретических знаний студентов. Примерная продолжительность — до 15 минут. Вторая часть — выступление студентов с докладами, которые должны сопровождаться презентациями с целью усиления наглядности восприятия, по одному из вопросов семинарского занятия. Обязательный элемент доклада – представление и анализ статистических данных, обоснование социальных последствий любого экономического факта, явления или процесса. Примерная продолжительность — 20-25 минут. После докладов следует их обсуждение – дискуссия. В ходе этого этапа семинарского занятия могут быть заданы уточняющие вопросы к докладчикам. Примерная продолжительность – до 15-20 минут. Если программой предусмотрено выполнение практического задания в

рамках конкретной темы, то преподавателями определяется его содержание и дается время на его выполнение, а затем идет обсуждение результатов. Если практическое задание должно было быть выполнено дома, то на семинарском занятии преподаватель проверяет его выполнение (устно или письменно). Примерная продолжительность – 15-20 минут. Подведением итогов заканчивается семинарское занятие. Студентам должны быть объявлены оценки за работу и даны их четкие обоснования. Примерная продолжительность — 5 минут.

Работа с литературными источниками

В процессе подготовки к семинарским занятиям, студентам необходимо обратить особое внимание на самостоятельное изучение рекомендованной учебно-методической (а также научной и популярной) литературы. Самостоятельная работа с учебниками, учебными пособиями, научной, справочной и популярной литературой, материалами периодических изданий и Интернета, статистическими данными является наиболее эффективным методом получения знаний, позволяет значительно активизировать процесс овладения информацией, способствует более глубокому усвоению изучаемого материала, формирует у студентов свое отношение к конкретной проблеме. Более глубокому раскрытию вопросов способствует знакомство с дополнительной литературой, рекомендованной преподавателем по каждой теме семинарского или практического занятия, что позволяет студентам проявить свою индивидуальность в рамках выступления на данных занятиях, выявить широкий спектр мнений по изучаемой проблеме.

Методические рекомендации по проведению опроса

Опрос проводится устно и включает в себя вопросы не только на знание, но и на понимание теоретического материала, а также вопросы, позволяющие понять, может ли студент применять полученные теоретические знания на практике.

До проведения опроса преподаватель может предоставить обучающимся перечень конкретных вопросов, которые будут заданы в ходе опроса или же порекомендовать необходимую для подготовки к опросу литературу, которую студентам надо будет изучить самостоятельно.

По окончании опроса преподаватель подводит итоги опроса и выставляет соответствующие баллы.

Основные задачи самостоятельной работы:

- 1) закрепление полученных ранее теоретических знаний;
- 2) выработка навыков самостоятельной работы;
- 3) выяснение подготовленности студента к будущей практической работе;

Весь процесс написания контрольной работы можно условно разделить на следующие этапы:

- а) выбор темы и составление предварительного плана работы;
- б) сбор научной информации, изучение литературы;
- в) анализ составных частей проблемы, изложение темы;
- г) обработка материала в целом.

Подготовку контрольной работы следует начинать с повторения соответствующего раздела учебника, учебных пособий по данной теме и конспектов лекций, прочитанных ранее. Приступать к выполнению работы без изучения основных положений и понятий науки, не следует, так как в этом случае студент, как правило, плохо ориентируется в материале, не может отграничить смежные вопросы и сосредоточить внимание на основных, первостепенных проблемах рассматриваемой темы.

После выбора темы необходимо внимательно изучить методические рекомендации по подготовке контрольной работы, составить план работы, который должен включать основные вопросы, охватывающие в целом всю прорабатываемую тему.

Вопросы для самостоятельной подготовки к занятиям:

1. Представлений о термине «риск» в историческом разрезе.
2. Риск, как один из отличительных признаков предпринимательской деятельности.

3. Неопределенность, связанная со средой, в которой принимается решение и риск.
4. Причины возникновения и факторы риска.
5. Концепция приемлемого риска и идея управления риском.
6. Различные уровни риска при управлении им и движение к приемлемому уровню.
7. Этапы реализации концепции приемлемого риска.
8. Цель риск-менеджмента.
9. Основные задачи, решаемые риск-менеджментом
10. Четыре основных метода управления риском.
11. Использование рыночной информации при управлении риском
12. Выявление факторов риска
13. Внешние и внутренние факторы риска и их классификация.
14. Финансовая отчетность компании, как один из основных источников информации о факторах риска. Использование финансовой отчетности для выявления факторов риска.
15. Внешняя доступная информация, как источник идентификации рисков.
16. Многофакторная модель и предположения, положенные в ее основу.
17. Теория арбитражного ценообразования и ее связь с многофакторной моделью.
18. Применения многофакторной модели для выявления значимых факторов риска и их оценки.
19. Модель VaR и предположения, лежащие в ее основе.
20. Базельский вариант модели VaR.
21. Применение методов статистического моделирования (Монте – Карло) для оценки величины VaR без предположения о логнормальности.
22. Определение меры ожидаемого дефицита ES и сравнения ее с VaR.
- Свойства ES.
23. Оценка меры ожидаемого дефицита ES в предположении нормальности распределения.
24. Особенности оценки меры ожидаемого дефицита ES методом Монте Карло.
25. Ценообразование фьючерсных контрактов с помощью модели «cash-and-carry».
26. Ценообразование опционов, формула Блэка—Шоулза.
27. Арбитражные операции.
28. Спрэды и стратегии хеджирования с их использованием.
29. Стрэнглы и стратегии хеджирования с их использованием.
30. Стрэддлы и стратегии хеджирования с их использованием.
31. Совершенное хеджирование и частичное хеджирование.
32. Коэффициент хеджирования.
33. Оценка коэффициента хеджирования с помощью линейной регрессии.
34. Хеджирование с минимальной дисперсией.
35. Коэффициент хеджирования с минимальной дисперсией.
36. Использование коэффициента детерминации для определения степени эффективности хеджирования.

6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", включая перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

6.1 Основная литература:

1. Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 2 т : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / П. Г. Белов. — М. : Издательство Юрайт, 2015. — 733 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-4703-8. <https://www.biblio-online.ru/book/5471D44E-2B8B-45A8-90F0-C4C4416B0C39>
2. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. — М. : Издательство Юрайт, 2016. — 414 с. —

- (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00945-3. <https://www.biblio-online.ru/book/E098C311-CAA9-4FD5-AC72-5F801419DD64>
3. Хоминич И. П. [и др.]. Управление финансовыми рисками: учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры /под ред. И. П. Хоминич, И. В. Пещанской. — М. : Издательство Юрайт, 2016. — 345 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01019-0. <https://www.biblio-online.ru/book/419260FD-3B72-4848-A8C3-B8EBABF94F86>

6.2 Дополнительная литература:

1. Галанов В.А. Производные инструменты срочного рынка, М.: «Финансы и статистика», 2002.
2. Гэлаи Д., Кроуи М., Минасян В.Б., Марк Р. Основы риск-менеджмента, М.: ЮРАЙТ, 2016. <https://www.biblio-online.ru/book/B09D2080-475C-4D6A-A567-EC01EE10B8CD>
3. Дамодаран А. Инвестиционная оценка, М.: «Альпина Бизнес Букс», 2016. https://e.lanbook.com/book/32506#book_name
4. Лимитовский М.И. Инвестиционные проекты и реальные опционы на развивающихся рынках, М.: Издательство «Юрайт», 2016. <https://www.biblio-online.ru/book/46E3DAF4-2C61-4804-9C60-DB5396084A34>
5. Лимитовский М.А., Лобанова Е.Н., Минасян В.Б., Паламарчук В.П. , Корпоративный финансовый менеджмент:, М.: Юрайт, 2016, http://www.biblio-online.ru/thematic/?56&id=urait.content.9791AEF7-E742-460D-8AAF-53116370FBCB&type=c_pub
6. Шарп У.Ф., Александер Г.Дж., Бэйли Д.В. Инвестиции, М.: «ИНФРА – М», 2006.

6.3 Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов:

1. Методические материалы по подготовке к международному экзамену по сертификации США Раздел «Прикладная теория портфеля» М.: Гильдия инвестиционных и финансовых аналитиков РФ, 2005
2. Буренин А.Н. Форварды, фьючерсы, опционы, экзотические и погодные производные, М.: «Научно-техническое общество им. академика С.И. Вавилова», 2005.
3. Энциклопедия финансового риск-менеджмента, «Альпина Бизнес Букс», 2005.
4. Шапкин А.С., Шапкин В.А. Теория риска и моделирование рисков ситуаций, Издательско – торговая корпорация «Дашков и К0, 2005.

6.4 Интернет-ресурсы, справочные материалы:

- www.derech.ru
- www.riskmetrics.com

7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

Занятия проводятся в учебных аудиториях, оснащенных рабочим местом преподавателя (стол, стул, кафедра), рабочими местами студентов (столы, стулья) по количеству студентов, доской меловой или белой для написания маркерами или флипчартом для бумаги большого формата, маркерами (красный, черный, зеленый, синий), губкой для досок, оборудованием для показа презентаций и слайдов (компьютер, проектор, экран).

Используется следующее программное обеспечение:

Microsoft Windows 10
Microsoft Office Professional 2016
Acrobat Professional AcademicEdition License Russian