

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

**федеральное государственное автономное  
образовательное учреждение высшего образования\_  
«Национальный исследовательский Нижегородский государственный университет  
им. Н.И. Лобачевского»**

Арзамасский филиал ННГУ - Психолого-педагогический факультет

---

УТВЕРЖДЕНО

решением Ученого совета ННГУ

протокол № 10 от 02.12.2024 г.

**Рабочая программа дисциплины**

Финансовые риски

---

Уровень высшего образования

Бакалавриат

---

Направление подготовки / специальность

38.03.01 - Экономика

---

Направленность образовательной программы

Экономика и финансы организаций (предприятий)

---

Форма обучения

очно-заочная

---

г. Арзамас

2025 год начала подготовки

## 1. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина Б1.В.02 Финансовые риски относится к части, формируемой участниками образовательных отношений образовательной программы.

## 2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы (компетенциями и индикаторами достижения компетенций)

| Формируемые компетенции<br>(код, содержание компетенции)   | Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), в соответствии с индикатором достижения компетенции   |  | Наименование оценочного средства        |                               |
|--|---|--|---|-------------------------------|
|  | Индикатор достижения компетенции<br>(код, содержание индикатора)  | Результаты обучения по дисциплине  | Для текущего контроля успеваемости      | Для промежуточной аттестации  |
| ПК-3: Способен анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной финансовой, бухгалтерской и иной информации, выявлять тенденции изменения экономических и социально-экономических показателей и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений | ПК-3.1: Формирует, анализирует и интерпретирует финансово-экономическую информацию.<br>ПК-3.2: Выявляет тенденции и использует результаты анализа информации для принятия управленческих решений. | ПК-3.1:<br>Знать<br>виды рисков, методы управления рисками и модели оценки рисковых инвестиций и стоимости бизнеса; методы измерения риска и критерии принятия рисковых решений<br>Уметь<br>использовать классификацию и методы оценки рисков в разработке управленческих решений<br>Владеть<br>навыками критически оценить предлагаемые варианты рисковых управленческих решений<br><br>ПК-3.2:<br>Знать<br>классификацию ситуаций разработки и реализации управленческих решений по степени риска; взаимосвязь и закономерности формирования неопределенности и риска при разработке управленческих решений<br>Уметь<br>выбирать критерии эффективности принятия рисковых решений<br>Владеть<br>навыками оценки рисков и | Практическое задание<br>Реферат<br>Тест | Зачёт:<br>Контрольные вопросы |

|  |  |   |   |                               |
|--|--|---|---|-------------------------------|
|  |  | разработки предложений по совершенствованию управленческих решений с учетом факторов риска  |   |                               |
| ПК-8: Способен на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели и содержательно интерпретировать полученные результаты | ПК-8.1: Строит стандартные теоретические и эконометрические модели.<br>ПК-8.2: Содержательно интерпретирует результаты экономического моделирования. | <p>ПК-8.1:</p> <p>Знать</p> <p>категории риска в науке и практике менеджмента; виды рисков, принципы и методы управления рисками; подходы к оценке рисков; методы анализа рисков</p> <p>Уметь</p> <p>выбрать необходимый инструментарий для обработки данных, анализа и обоснования рискованных решений хозяйствующих субъектов</p> <p>Владеть</p> <p>навыками анализа результатов расчетов и обоснования полученных выводов при принятии рискованных решений хозяйствующих субъектов</p> <p>ПК-8.2:</p> <p>Знать</p> <p>факторы и источники риска в управлении; объекты управления рисками; роль неопределенности в формировании риска; взаимосвязь риска и эффективности управления</p> <p>Уметь</p> <p>готовить аналитический отчет по оценке рисков при принятии решений</p> <p>Владеть</p> <p>способностью обоснования полученных выводов при принятии рискованных решений хозяйствующих субъектов</p> | Практическое задание<br>Реферат<br>Тест | Зачёт:<br>Контрольные вопросы |

### 3. Структура и содержание дисциплины

#### 3.1 Трудоемкость дисциплины

|  |              |
|--|--------------|
|  | очно-заочная |
|--|--------------|

|  |                          |
|--|--------------------------|
| <b>Общая трудоемкость, з.е.</b>  | <b>3</b>                 |
| <b>Часов по учебному плану</b>   | <b>108</b>               |
| в том числе  |                          |
| <b>аудиторные занятия (контактная работа):</b>                           |                          |
| - занятия лекционного типа   | <b>10</b>                |
| - занятия семинарского типа (практические занятия / лабораторные работы) | <b>8</b>                 |
| - КСР  | <b>1</b>                 |
| <b>самостоятельная работа</b>  | <b>89</b>                |
| <b>Промежуточная аттестация</b>  | <b>0</b><br><b>Зачёт</b> |

### 3.2. Содержание дисциплины

(структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и виды учебных занятий)

| Наименование разделов и тем дисциплины                      | Всего<br>(часы)  | в том числе  |  |                  |   |
|---|------------------|--|--|------------------|---|
|   |                  | Контактная работа (работа во взаимодействии с преподавателем), часы из них |  |                  | Самостоятельная работа обучающегося, часы |
|   |                  | Занятия лекционного типа   | Занятия семинарского типа (практические занятия/лабораторные работы), часы | Всего            |   |
|   | о<br>з<br>Ф<br>о | о<br>з<br>Ф<br>о   | о<br>з<br>Ф<br>о   | о<br>з<br>Ф<br>о | о<br>з<br>Ф<br>о                          |
| Тема 1. Понятие и измерение риска                           | 17               | 1  | 2  | 3                | 14  |
| Тема 2. Понятие о теории оценивания финансовых активов      | 21               | 4  | 2  | 6                | 15  |
| Тема 3. Применение теории оценивания активов                | 18               | 1  | 2  | 3                | 15  |
| Тема 4. Методы риск-менеджмента                             | 19               | 2  | 2  | 4                | 15  |
| Тема 5. Фундаментальная роль риска в финансовом менеджменте | 32               | 2  | 0  | 2                | 30  |
| Аттестация  | 0                |  |  |                  |   |
| КСР   | 1                |  |  | 1                |   |
| Итого   | 108              | 10   | 8  | 19               | 89  |

#### Содержание разделов и тем дисциплины

##### Тема 1. Понятие и измерение риска

«Риски изменчивости» и расчет стандартного отклонения. Смысл стандартного отклонения; альтернативные меры риска. «Риски потерь», методики их количественного измерения.

##### Тема 2. Понятие о теории оценивания финансовых активов

Выбор индивида в условиях неопределенности. Функция ожидаемой полезности Неймана-Моргенштерна. «Безрисковый эквивалент» рискованного дохода. Теория инвестиционного портфеля. Подход Г.Марковица и его дальнейшее развитие. Подход к оцениванию финансового актива на основе двухпериодной функции полезности. Формулировка в терминах цены и в терминах ожидаемой

доходности. «Портфельное» приближение. Коэффициент бета актива. Модель оценивания финансовых активов (САРМ) У.Шарпа. Систематический и несистематический риски активов. Недостатки классических моделей оценивания

#### Тема 3. Применение теории оценивания активов

Выбор индивида между потреблением и инвестированием в рискованные активы. Обоснование оценивания стоимости на основе дисконтирования будущих денежных потоков. Управление коллективными инвестициями через ПИФы различного типа, ОФБУ и хедж-фонды

#### Тема 4. Методы риск-менеджмента

Избежание, лимитирование, диверсификация, страхование и хеджирование, их применение. Производные ценные бумаги (фьючерсы) и их применение для управления риском. Опционы и опционные стратегии.

#### Тема 5. Фундаментальная роль риска в финансовом менеджменте

Риск как негативный и как позитивный фактор стоимости. Применение теории опционов к оцениванию инвестиционных проектов в условиях высокой неопределенности.

### **4. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся**

Самостоятельная работа обучающихся включает в себя подготовку к контрольным вопросам и заданиям для текущего контроля и промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины приведенным в п. 5.

Для обеспечения самостоятельной работы обучающихся используются:  
Электронные курсы, созданные в системе электронного обучения ННГУ:

Финансовые риски, <https://e-learning.unn.ru/course/view.php?id=11036>.

Иные учебно-методические материалы:

<https://arz.unn.ru/sveden/document/>

[https://arz.unn.ru/pdf/Metod\\_all\\_all.pdf](https://arz.unn.ru/pdf/Metod_all_all.pdf)

### **5. Фонд оценочных средств для текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)**

#### **5.1 Типовые задания, необходимые для оценки результатов обучения при проведении текущего контроля успеваемости с указанием критериев их оценивания:**

##### **5.1.1 Типовые задания (оценочное средство - Практическое задание) для оценки сформированности компетенции ПК-3:**

*Задание 1.* Для организации финансирования инновационного проекта необходимо привлечь 8 млрд. руб. Для этого акционерное общество может выпустить один из следующих видов ценных бумаг:

1. 10 000 000 привилегированных акций номиналом 1 000 руб.;
2. 10 000 конвертируемых облигаций номиналом 1 000 000 руб.;

3. 1 000 дисконтных векселей номиналом 10 000 000 р. по цене размещения 85 %.

Известно, что акции размещаются на 95 %, облигации – на 80 %. Реализация векселей составляет в среднем 90 %.

Выберите наименее рискованный вариант привлечения финансовых средств, оценив ожидаемое привлечение инвестиций по каждому варианту.

*Задание 2.* Оценить степень риска предприятия; предложить мероприятия для стабилизации деятельности предприятия.

Таблица

|   | Показатель, тыс. руб. | 2018г. | 2019г. |
|---|-----------------------|--------|--------|
| 1. Оборотные средства                                   |                       | 258,9  | 245,4  |
| 2. Материалы и продукты питания                         |                       | 14,6   | 12,6   |
| 3. МБП  |                       | 19,6   | 18,6   |
| 4. Текущая задолженность                                |                       | 55,7   | 64,6   |
| 5. Уставный капитал                                     |                       | 146,3  | 146,3  |
| 6. Пaeвой капитал                                       |                       | 445,5  | 415,5  |
| 7. Дополнительно вложенный капитал                      |                       | 22,9   | 22,3   |
| 8. Резервный капитал                                    |                       | -      | -      |
| 9. Объем продаж   |                       | 45,4   | 58,6   |
| 10. Цена за ед. (грн.)                                  |                       | 220,1  | 159,6  |
| 11. Прибыль от реализации ОПФ                           |                       | 44,3   | 440,3  |
| 12. Необоротные активы                                  |                       | 153,3  | 44,5   |
| 13. Векселя полученные                                  |                       | 99,3   | 87,6   |
| 14. Дебиторская задолженность за товары, работы, услуги |                       | 124,3  | 55,6   |
| 15. Дебиторская задолженность по расчетам               |                       | 22,4   | 33,3   |
| 16. Текущие финансовые инвестиции                       |                       | 18,3   | 12,1   |
| 17. Расходы будущих периодов                            |                       | 28,6   | 14,8   |

R=0...1 – невозможность выполнять обязательства и нормально функционировать.

R=1...30 – высокая степень риска выхода на рынок с новым товаром.

R=31...55 – умеренно высокая степень риска выхода на рынок с новым товаром.

R=56...76 – умеренно низкая степень риска выхода на рынок с новым товаром с минимальными затратами.

R=77...100 – низкая степень риска выхода на рынок с новым товаром с минимальными затратами и быстрой окупаемостью.

### 5.1.2 Типовые задания (оценочное средство - Практическое задание) для оценки сформированности компетенции ПК-8:

*Задание 1.* По исходным данным о деятельности двух предприятий (таблица 2) установить, какому риску подвергаются эти предприятия и у кого из них возможны большие расходы.

Таблица

| Показатели  | Ед. изм.  | Значение |
|---|-----------|----------|
| 1.Постоянные годовые расходы предприятия.                     | тыс. руб. | 600      |
| 2.Переменные расходы от годового объема продаж:               |           |          |
| - предприятие А;  | %         | 13       |
| - предприятие Б.  | %         | 24       |
| 3. Запланированный объем продаж на год.                       | тыс. руб. | 720      |
| 4.Возможное снижение спроса на продукцию каждого предприятия. | %         | 15       |

*Задание 2.* Проанализируйте перечень возможных внутриотраслевых рисков, связанных с деятельностью предприятия по производству мороженого, оцените вероятность их наступления, основываясь на личном опыте на основе предлагаемой системы оценки рисков, сформулируйте рекомендации.

#### Критерии оценивания (оценочное средство - Практическое задание)

| Оценка     | Критерии оценивания  |
|------------|--|
| зачтено    | задание выполнено полностью; в решении задач отсутствуют ошибки и пробелы, возможны неточности, не являющиеся следствием незнания или непонимания учебного материала |
| не зачтено | задание выполнено не полностью; имеются существенные ошибки и пробелы в решении задач, являющиеся следствием незнания или непонимания учебного материала             |

### 5.1.3 Типовые задания (оценочное средство - Реферат) для оценки сформированности компетенции ПК-3:

1. Использование превентивных мероприятий по управлению рисками.
2. Прогнозирование потерь от реализации рисков: принципы, подходы, методы.
3. Программа управления рисками: разработка и использование.
4. Комплексное использование методов управления рисками.
5. Управление рисками в малом предпринимательстве.
6. Организация управления рисками на промышленном предприятии.

7. Организация управления рисками в финансово-кредитном учреждении.
8. Особенности управления рисками финансово-промышленной группы.
9. Особенности управления рисками транснациональной корпорации.
10. Управление рисками инвестиционного проекта.
11. Управление рисками в антикризисном менеджменте.
12. Информационное обеспечение управления рисками: принципы создания и использования информационной системы организации

#### **5.1.4 Типовые задания (оценочное средство - Реферат) для оценки сформированности компетенции ПК-8:**

1. Методы оценки эффективности управления рисками.
2. Использование количественных методов анализа и оценки рисков.
3. Использование качественных методов анализа и оценки рисков.
4. Инновационные технологии в управлении рисками.
5. Роль субъективных факторов в управлении рисками.
6. Правовое обеспечение деятельности по управлению рисками в РФ.
7. Управление кадровыми рисками: понятие и история формирования
8. Управление кадровыми рисками как приоритет ЕС и ООН
9. Управление кадровыми рисками и этика бизнеса
10. Управление кадровыми рисками и бренд организации
11. Эволюция управления рисками: концепции, подходы и их условия.
12. Классификация рисков: виды, принципы разработки, использование.

#### **Критерии оценивания (оценочное средство - Реферат)**

| Оценка              | Критерии оценивания  |
|---------------------|--|
| отлично             | Реферативная работа полностью раскрывает основные вопросы теоретического материала. Студент приводит информацию из первоисточников и изданий периодической печати, приводит практические примеры, отвечает на дополнительные вопросы преподавателя и студентов (в процессе выступления с докладом)     |
| хорошо              | Реферативная работа частично раскрывает основные вопросы теоретического материала. Студент приводит информацию из первоисточников, отвечает на дополнительные вопросы преподавателя и студентов (в процессе выступления с докладом), но при этом дает не четкие ответы, без достаточно их аргументации |
| удовлетворительно   | Реферативная работа в общих чертах раскрывает основные вопросы теоретического материала. Студент приводит информацию только из учебников. При ответах на дополнительные вопросы (в процессе выступления с докладом) путается в ответах, не может дать понятный и аргументированный ответ               |
| неудовлетворительно | нет информации о проблематике работы и ее месте в контексте других работ по исследуемой теме   |



### **5.1.5 Типовые задания (оценочное средство - Тест) для оценки сформированности компетенции ПК-3:**

**1. С чем связано возникновение социальной неопределенности при принятии рискованных решений?**

- А) С влиянием личностных характеристик руководителя и исполнителей;
- Б) С неопределенностью внешней среды;
- В) С возникновением различных социальных связей и коммуникаций при реализации решений.

**2. Объективная вероятность наступления рискованного события...**

- А) Основана на предположении о возможности получения определенного эффекта;
- Б) Базируется на расчете частоты, с которой происходит процесс или явление.

**3 Назовите основные причины, ограничивающие практическое применение статистических данных для определения вероятностей наступления событий**

- А) Недостаточный объем статистических данных или их отсутствие;
- Б) Влияние субъективных особенностей исследователя;
- В) Наличие неопределенности в реальных условиях предпринимательской деятельности.

### **5.1.6 Типовые задания (оценочное средство - Тест) для оценки сформированности компетенции ПК-8:**

**1. Современное понятие «риск» ...**

- А) Используется для обозначения возможного материального ущерба;
- Б) Связано как с возможным материальным ущербом, так и с возможным выигрышем;
- В) отождествляется только с полученным материальным ущербом.

**2. Классическая теория предпринимательского риска ((Дж. Милль, Н.У. Сениор) отождествляет риск с...**

- А) Математическим ожиданием возможных потерь от предпринимательской деятельности;
- Б) Вероятностью наступления рискованного события;
- В) Неопределенностью предпринимательской деятельности.

**3. Величина возможных колебаний прибыли была впервые названа критерием риска представителями...**

- А) Классической теории предпринимательского риска;
- Б) Неоклассической школы риска;
- В) Кейнсианской научной школы.

**4. Как соотносятся понятие «неопределенность» и понятие «риск»?**

- А) В реальной предпринимательской деятельности эти понятия являются синонимами;
- Б) Риск характеризует такую ситуацию, когда наступление некоторых событий может быть оценено количественно, а неопределенность предполагает невозможность оценки вероятности наступления таких событий;
- В) Неопределенность характеризует условия внешней среды, а риск – действия предпринимателя, поэтому эти понятия не связаны.

**5 В чем состоит регулятивная функция риска?**

- А) В необходимости идентификации, оценки, управления риском по всем направлениям деятельности организации;
- Б) В необходимости затрат на возмещение ущерба в случае наступления рискованного события.

**6. Деловая активность предприятия, маркетинговая стратегия, политика в области управления персоналом, производственный потенциал выступают**

- А) Внешними факторами риска;
- Б) Внутренними факторами риска.

**7. Спекулятивные (динамические, коммерческие) риски -**

- А) Всегда несут потери для предпринимательской деятельности;
- Б) Могут нести как потери, так и дополнительную прибыль;
- В) Характеризуют дополнительные возможности получения прибыли.

### **Критерии оценивания (оценочное средство - Тест)**

| Оценка              | Критерии оценивания          |
|---------------------|------------------------------|
| отлично             | 85-100% правильных ответов   |
| хорошо              | 66-84% правильных ответов    |
| удовлетворительно   | 50-65% правильных ответов    |
| неудовлетворительно | менее 50% правильных ответов |

### **5.2. Описание шкал оценивания результатов обучения по дисциплине при промежуточной аттестации**

#### **Шкала оценивания сформированности компетенций**

| Уровень сформированности компетенций (индикатора достижения компетенций) | неудовлетворительно  | удовлетворительно  | хорошо  | отлично   |
|--|--|--|---|---|
|  | не зачтено   | зачтено  |   |   |
| <u>Знания</u>  | Уровень знаний ниже минимальных требований. Имели место грубые ошибки                          | Минимально допустимый уровень знаний. Допущено много негрубых ошибок   | Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки. Допущено несколько негрубых ошибок   | Уровень знаний в объеме, соответствующем программе подготовки, без ошибок   |
| <u>Умения</u>  | При решении стандартных задач не продемонстрированы основные умения. Имели место грубые ошибки | Продemonстрированы основные умения. Решены типовые задачи с негрубыми ошибками. Выполнены все задания, но не в полном объеме | Продemonстрированы все основные умения. Решены все основные задачи с негрубыми ошибками. Выполнены все задания в полном объеме, но некоторые с недочетами | Продemonстрированы все основные умения. Решены все основные задачи с отдельными незначительными недочетами, выполнены все задания в полном объеме |
| <u>Навыки</u>  | При решении стандартных задач не продемонстрированы базовые навыки. Имели место грубые ошибки  | Имеется минимальный набор навыков для решения стандартных задач с некоторыми недочетами                                      | Продemonстрированы базовые навыки при решении стандартных задач с некоторыми недочетами   | Продemonстрированы навыки при решении нестандартных задач без ошибок и недочетов  |

### Шкала оценивания при промежуточной аттестации

| Оценка     |                     | Уровень подготовки   |
|------------|---------------------|--|
| зачтено    | отлично             | Все компетенции (части компетенций), на формирование которых направлена дисциплина, сформированы на уровне не ниже «отлично», при этом хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «отлично»                     |
|            | хорошо              | Все компетенции (части компетенций), на формирование которых направлена дисциплина, сформированы на уровне не ниже «хорошо», при этом хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «хорошо»                       |
|            | удовлетворительно   | Все компетенции (части компетенций), на формирование которых направлена дисциплина, сформированы на уровне не ниже «удовлетворительно», при этом хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «удовлетворительно» |
| не зачтено | неудовлетворительно | Хотя бы одна компетенция сформирована на уровне «неудовлетворительно».   |

### 5.3 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки результатов обучения на промежуточной аттестации с указанием критериев их оценивания:

#### 5.3.1 Типовые задания (оценочное средство - Контрольные вопросы) для оценки сформированности компетенции ПК-3

1. Подход Г.Марковица и его дальнейшее развитие
2. Управление коллективными инвестициями через ПИФы различного типа, ОФБУ и хедж-фонды
3. Метод избежания рисков
4. Метод лимитирования рисков
5. Метод диверсификация
6. Метод страхования и хеджирования
7. Производные ценные бумаги (фьючерсы) и их применение для управления риском
8. Опционы и опционные стратегии
9. Риск как негативный и как позитивный фактор стоимости
10. Применение теории опционов к оцениванию инвестиционных проектов в условиях высокой неопределенности

#### 5.3.2 Типовые задания (оценочное средство - Контрольные вопросы) для оценки сформированности компетенции ПК-8

1. Риски изменчивости
2. Порядок расчета стандартного отклонения
3. Понятие стандартного отклонения
4. Альтернативные меры риска
5. Риски потерь
6. Методики количественного измерения рисков потерь
7. Выбор индивида в условиях неопределенности
8. «Безрисковый эквивалент» рискованного дохода
9. Теория инвестиционного портфеля
10. Подход к оцениванию финансового актива на основе двухпериодной функции полезности
11. Формулировка в терминах цены и в терминах ожидаемой доходности
12. «Портфельное» приближение
13. Коэффициент бета актива
14. Модель оценивания финансовых активов (САРМ) У.Шарпа

15. Систематический и несистематический риски активов
16. Недостатки классических моделей оценивания риска
17. Выбор индивида между потреблением и инвестированием в рискованные активы
18. Обоснование оценивания стоимости на основе дисконтирования будущих денежных потоков

### Критерии оценивания (оценочное средство - Контрольные вопросы)

| Оценка     | Критерии оценивания  |
|------------|--|
| зачтено    | Ответ полный и правильный на основании изученной теории; теоретический материал и решение поставленных задач изложены в необходимой логической последовательности, грамотный научный язык; ответ самостоятельный. Могут быть допущены две-три не существенные ошибки, исправленные по требованию преподавателя |
| не зачтено | Ответ обнаруживает непонимание студентом основного содержания учебного материала или допущены существенные ошибки, которые не могут быть исправлены при наводящих вопросах преподавателя   |

### 6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

Основная литература:

1. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. - 2-е изд. ; испр. и доп. - Москва : Юрайт, 2022. - 569 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/489981> (дата обращения: 14.08.2022). - ISBN 978-5-534-13380-6 : 2119.00. - Текст : электронный // ЭБС "Юрайт"., <https://e-lib.unn.ru/MegaPro/UserEntry?Action=FindDocs&ids=818054&idb=0>.
2. Белов П. Г. Системный анализ и программно-целевой менеджмент рисков : учебник и практикум / П. Г. Белов. - Москва : Юрайт, 2022. - 289 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/493057> (дата обращения: 14.08.2022). - ISBN 978-5-534-04690-8 : 939.00. - Текст : электронный // ЭБС "Юрайт"., <https://e-lib.unn.ru/MegaPro/UserEntry?Action=FindDocs&ids=817626&idb=0>.
3. Вяткин В. Н. Риск-менеджмент / Вяткин В. Н., Гамза В. А., Маевский Ф. В. - 2-е изд. ; пер. и доп. - Москва : Юрайт, 2022. - 365 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/489098> (дата обращения: 05.01.2022). - ISBN 978-5-9916-3502-8 : 1129.00. - Текст : электронный // ЭБС "Юрайт"., <https://e-lib.unn.ru/MegaPro/UserEntry?Action=FindDocs&ids=788705&idb=0>.

Дополнительная литература:

1. Пименов Н. А. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности / Пименов Н. А. - 2-е изд. ; пер. и доп. - Москва : Юрайт, 2022. - 326 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/489025> (дата обращения: 05.01.2022). - ISBN 978-5-534-04539-0 : 1019.00. - Текст : электронный // ЭБС "Юрайт"., <https://e-lib.unn.ru/MegaPro/UserEntry?Action=FindDocs&ids=784442&idb=0>.
2. Управление финансовыми рисками. Практикум : учебное пособие / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич. - Москва : Юрайт, 2022. - 129 с. - (Высшее образование). - URL: <https://urait.ru/bcode/497605> (дата обращения: 14.08.2022). - ISBN 978-5-534-13920-4 : 0.00. - Текст :

электронный // ЭБС "Юрайт"., <https://e-lib.unn.ru/MegaPro/UserEntry?Action=FindDocs&ids=820864&idb=0>.

3. Основы риск-менеджмента : - / Кроуи М., Гэлаи Д., Минасян В. Б., Марк Р. - Москва : Юрайт, 2021. - 390 с. - (Высшее образование). - ISBN 978-5-534-02578-1. - Текст : электронный // ЭБС "Юрайт"., <https://e-lib.unn.ru/MegaPro/UserEntry?Action=FindDocs&ids=761737&idb=0>.

Программное обеспечение и Интернет-ресурсы (в соответствии с содержанием дисциплины):

- Лицензионное программное обеспечение: Операционная система Windows.
- Лицензионное программное обеспечение: Microsoft Office.

Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

- Российский индекс научного цитирования (РИНЦ), платформа Elibrary: национальная информационно-аналитическая система. Адрес доступа: [http://elibrary.ru/project\\_risc.asp](http://elibrary.ru/project_risc.asp)
- ГАРАНТ. Информационно-правовой портал [Электронный ресурс]. – Адрес доступа: <http://www.garant.ru>

- Свободно распространяемое программное обеспечение:
- программное обеспечение LibreOffice;
- программное обеспечение «КонсультантПлюс»;
- программное обеспечение Paint.NET;
- Электронные библиотечные системы и библиотеки:
- Электронная библиотечная система "Лань" <https://e.lanbook.com/>
- Электронная библиотечная система "Консультант студента" <http://www.studentlibrary.ru/>
- Электронная библиотечная система "Юрайт" <http://www.ura.it.ru/ebs>
- Электронная библиотечная система "Znanium" <http://znanium.com/>
- Фундаментальная библиотека ННГУ. – Адрес доступа: [www.lib.unn.ru/](http://www.lib.unn.ru/)
- Сайт библиотеки Арзамасского филиала ННГУ. – Адрес доступа: <http://lib.arz.unn.ru/>

## **7. Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля)**

Учебные аудитории для проведения учебных занятий, предусмотренных образовательной программой, оснащены мультимедийным оборудованием (проектор, экран), техническими средствами обучения, компьютерами.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечены доступом в электронную информационно-образовательную среду.

Программа составлена в соответствии с требованиями ОС ННГУ по направлению подготовки/специальности 38.03.01 - Экономика.

Автор(ы): Митрофанова Марина Николаевна, кандидат экономических наук.

Рецензент(ы): Андреев Олег Евгеньевич, кандидат исторических наук.

Заведующий кафедрой: Акутина Светлана Петровна, доктор педагогических наук.

Программа одобрена на заседании методической комиссии от 27.11.2024 г., протокол № №9.