

# ЮЖНО-УРАЛЬСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

УТВЕРЖДАЮ:  
Директор института  
Высшая школа экономики и  
управления

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе  
электронного документооборота  
ЮУрГУ Южно-Уральского государственного университета

СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП

Кому выдан: Карпушкина А. В.  
Пользователь: karpushkinaav  
Дата подписания: 07.11.2022

А. В. Карпушкина

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

**дисциплины** Б.1.43 Риски управления портфелем финансовых активов  
**для специальности** 38.05.01 Экономическая безопасность  
**уровень специалист тип программы** Специалитет  
**специализация** Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности  
**форма обучения** очная  
**кафедра-разработчик** Экономическая безопасность

Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность, утверждённым приказом Минобрнауки от 16.01.2017 № 20

Зав.кафедрой разработчика,  
д.экон.н., доц.

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе  
электронного документооборота  
ЮУрГУ Южно-Уральского государственного университета

СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП

Кому выдан: Карпушкина А. В.  
Пользователь: karpushkinaav  
Дата подписания: 07.11.2022

А. В. Карпушкина

Разработчик программы,  
к.экон.н., доцент

Электронный документ, подписанный ПЭП, хранится в системе  
электронного документооборота  
ЮУрГУ Южно-Уральского государственного университета

СВЕДЕНИЯ О ВЛАДЕЛЬЦЕ ПЭП

Кому выдан: Воронина С. В.  
Пользователь: voroninaev  
Дата подписания: 07.11.2022

С. В. Воронина

Челябинск

## **1. Цели и задачи дисциплины**

Цели: формирование теоретических знаний и практических навыков в области формирования портфеля ценных бумаг и управления им с целью достижения оптимального соотношения риска и доходности. Задачи: – рассмотреть характеристики различных видов финансовых активов с использованием традиционных моделей ценообразования на фондовом рынке; – овладеть профессиональной терминологией в сфере портфельных инвестиций и рисков управления портфелем финансовых активов; – сформировать представление о портфельном инвестировании; – изучить основные методы оценки риска портфеля финансовых активов; – изучить новейшие методические и практические разработки управления портфелем финансовых активов.

## **Краткое содержание дисциплины**

В курсе рассматриваются теоретические аспекты формирования портфелей финансовых активов с позиции достижения оптимального соотношения риска и доходности. Особое внимание уделяется способам определения оптимальных портфелей и эффективной границы, а также моделям оценки доходности финансовых активов. Рассматриваются вопросы связанные со стратегиями управления портфелем финансовых активов и оценкой их рисков. Значительная часть курса посвящена вопросам оценки эффективности управления портфелем финансовых активов.

## **2. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины**

Планируемые результаты освоения ОП ВО (компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине (ЗУНЫ)
ПК-32 способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	Знать:– сущность и виды портфеля финансовых активов, способы формирования и оценки портфеля, состояние современного российского рынка портфельных инвестиций; – модели формирования портфеля финансовых активов и модель оценки доходности финансовых активов; – основные подходы и стратегии управления риском портфеля финансовых активов в современных экономических условиях. Уметь:принимать решения по управлению портфелем финансовых активов и вырабатывать рекомендации по снижению риска портфеля.
	Владеть:– умением самостоятельного анализа эффективности портфеля финансовых активов, оценки доходности и риска портфеля; – методами оценки риска финансовых активов и портфеля финансовых активов; – навыками профессиональной аргументации при разборе разнообразных ситуаций и выборе экономически рациональных решений при управлении портфелем финансовых активов в условиях риска и неопределенности.
ПК-34 способностью проводить комплексный	Знать:- основные риски и угрозы,

<p>анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов</p>	<p>сопутствующие портфелю финансовых активов, содержащим активы с высоким риском.</p>
	<p>Уметь:-принимать решения по управлению портфелем финансовых активов, содержащим активы с высоким риском.</p>
	<p>Владеть:-методами определения риска и доходность портфеля, содержащего высокорисковые активы.</p>

### 3. Место дисциплины в структуре ОП ВО

Перечень предшествующих дисциплин, видов работ учебного плана	Перечень последующих дисциплин, видов работ
Б.1.27 Экономическая статистика, Б.1.35 Оценка рисков, Б.1.24 Рынок ценных бумаг	Не предусмотрены

Требования к «входным» знаниям, умениям, навыкам студента, необходимым при освоении данной дисциплины и приобретенным в результате освоения предшествующих дисциплин:

Дисциплина	Требования
Б.1.35 Оценка рисков	<p>Знать: основные подходы к оценке и управлению рисками в современных экономических условиях; понятия неопределенности, риска, классификацию экономических рисков, причины возникновения рисковых ситуаций и возможные последствия. Уметь: проводить оценку возможных экономических рисков; разрабатывать решения по управлению рисками с целью снижения угроз экономической безопасности. Владеть: терминологией, лексикой и логикой управления рисками и оценки рисков; методами качественной и количественной оценки рисков.</p>
Б.1.24 Рынок ценных бумаг	<p>Знать: основные виды ценных бумаг, их сущность и особенности их обращения; процесс ценообразования ценных бумаг; основы инвестиционного анализа на рынке ценных бумаг и формирования инвестиционного портфеля; тенденции развития рынка ценных бумаг. Уметь: анализировать современное состояние рынка ценных бумаг; принимать решения инвестиционного характера, формировать инвестиционный портфель. Владеть: навыками расчета основных показателей доходности и риска ценных бумаг; навыками формирования портфеля ценных бумаг; методами расчета оценки эффективности управления портфелем ценных бумаг.</p>
Б.1.27 Экономическая статистика	<p>Знать: основы построения, расчета основных показателей экономической статистики. Уметь: рассчитывать на основе типовых методик статистические показатели. Владеть:</p>

	современными методами сбора, обработки и анализа статистических данных, необходимых для решения профессиональных задач.
--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## 4. Объём и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 з.е., 144 ч.

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах
		Номер семестра
		9
Общая трудоёмкость дисциплины	144	144
<i>Аудиторные занятия:</i>		
Лекции (Л)	16	16
Практические занятия, семинары и (или) другие виды аудиторных занятий (ПЗ)	48	48
Лабораторные работы (ЛР)	0	0
<i>Самостоятельная работа (СРС)</i>	80	80
Написание тематических докладов на заданные темы	10	10
Подготовка к экзамену	36	36
Выполнение расчетно-графических заданий (РГР1, РГР2, РГР3, РГР4, РГР5)	34	34
Вид итогового контроля (зачет, диф.зачет, экзамен)	-	экзамен

## 5. Содержание дисциплины

№ раздела	Наименование разделов дисциплины	Объем аудиторных занятий по видам в часах			
		Всего	Л	ПЗ	ЛР
1	Понятие финансового актива и его характеристики	8	2	6	0
2	Современная портфельная теория	16	4	12	0
3	Стратегия диверсификации Г. Марковица	8	2	6	0
4	Модели и методы оценки финансовых активов	16	4	12	0
5	Стратегии в управление портфелем финансовых активов	8	2	6	0
6	Показатели эффективности управления портфелем	8	2	6	0

### 5.1. Лекции

№ лекции	№ раздела	Наименование или краткое содержание лекционного занятия	Кол-во часов
1	1	Определения, основные характеристики и классификация финансовых активов, Базовая модель оценки финансовых активов Дж. Уильямса. Понятие риска. Виды риска.	2
2	2	Понятие портфеля ценных бумаг. Виды портфелей ценных бумаг.	2
3	2	Показатели доходности и риска портфеля ценных бумаг.	2
4	3	Математическая модель формирования портфеля финансовых активов Г.Марковица.	2

5	4	Модель оценки доходности финансовых активов (САРМ). Линия рынка капитала и линия рынка актива. Диагональная модель У. Шарпа	2
6	4	Многофакторные модели оценки финансовых активов. Модель Е.Фамы и К.Френча. Модель арбитражного ценообразования С.Росса	2
7	5	Активные и пассивные стратегии управление портфелем финансовых активов.	2
8	6	Относительные показатели оценки эффективности управления портфелем. Коэффициент эффективности для портфеля облигаций. Управления портфелем на основе индекса Дженсена.	2

## 5.2. Практические занятия, семинары

№ занятия	№ раздела	Наименование или краткое содержание практического занятия, семинара	Кол-во часов
1	1	Определения, основные характеристики и классификация финансовых активов. Расчет показателей доходности и риска активов.	2
2	1	Производные ценные бумаги: определения, общая характеристика. Формирование портфеля опционов и расчет его инвестиционных характеристик.	2
3	1	Основные инструменты статистического метода оценки риска финансового актива: дисперсия, среднеквадратическое отклонение, коэффициент вариации, распределение вероятности случайной величины	2
4	2	Виды портфелей финансовых активов. Ожидаемая доходность портфеля финансовых активов.	2
5	2	Теснота связи между доходностями активов при формировании портфеля: ковариация и коэффициент корреляции. Риск портфеля двух финансовых активов и портфеля, состоящего из нескольких финансовых активов.	2
6	2	Теснота связи между доходностями активов при формировании портфеля. Характеристика случаев различных значений коэффициентов корреляции. Решение задач.	2
7	2	На основе данных с сайта <a href="http://www.moex.com">www.moex.com</a> (Группа "Московская Биржа") формирование портфеля, состоящего из пяти финансовых активов и расчет доходности этого портфеля.	2
8	2	Расчет риска портфеля, состоящего из пяти финансовых активов на основе данных с сайта <a href="http://www.moex.com">www.moex.com</a> (Группа "Московская Биржа").	2
9	2	Расчет коэффициента систематического риска портфеля, состоящего из пяти финансовых активов, на основе данных с сайта <a href="http://www.moex.com">www.moex.com</a> (Группа "Московская Биржа") с помощью функции "Анализ данных" в MS Excel.	2
10	3	Модель формирования портфеля финансовых активов Г. Марковица. Решение задач.	2
11	3	Эффективный набор портфелей. Эффективная граница портфелей. Формирование эффективных портфелей.	2
12	3	Моделирование эффективной границы портфеля с помощью функции "Поиск решения" в MS Excel	2
13	4	Модель оценки капитальных активов (САРМ). Расчет по модели САРМ доходности финансовых активов.	2
14	4	Расчет по модели САРМ, бета-коэффициента риска портфеля с применением программы MS Excel.	2
15	4	Линия рынка капитала (CML) и линия рынка актива(SML). Решение задач.	2
16	4	Построение линий CML и SML для сформированного портфеля ценных бумаг с применением программы MS Excel.	2

17	4	Переоцененные и недооцененные финансовые активы (коэффициент альфа актива). Решение задач.	2
18	4	Построение многофакторной модели С. Росса.	2
19	5	Активные стратегии управления портфелем финансовых активов. Доклады на заданные темы.	2
20	5	Пассивные стратегии управления портфелем финансовых активов. Доклады на заданные темы.	2
21	5	Моделирование портфеля финансовых активов по моделям активных и пассивных стратегий управления	2
22	6	Расчет относительных показателей оценки эффективности управления портфелем. Решение задач.	2
23	6	Расчет коэффициента эффективности управления портфелем облигаций.	2
24	6	Оценка эффективности управления портфелем финансовых активов на основе индекса Дженсена.	2

### 5.3. Лабораторные работы

Не предусмотрены

### 5.4. Самостоятельная работа студента

Выполнение СРС		
Вид работы и содержание задания	Список литературы (с указанием разделов, глав, страниц)	Кол-во часов
Подготовка к практическим занятиям. Решение задач по разделам 1, 2 и 3	Раскатова М.И. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, расчетные задания к разделам 1-6.	24
Написание тематических докладов	Раскатова М.И. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания, тема 2, тема 5, темы докладов.	20
Подготовка к экзамену	1,2,3 все разделы.	36

## 6. Инновационные образовательные технологии, используемые в учебном процессе

Инновационные формы учебных занятий	Вид работы (Л, ПЗ, ЛР)	Краткое описание	Кол-во ауд. часов
Групповые дискуссии	Практические занятия и семинары	На практических занятиях по разделу 2 и 5 заслушиваются выступления студентов на выбранную студентом из списка тему, которая затем обсуждается со студентами группы с участием преподавателя.	6
Лекция с заранее запланированными ошибками	Лекции	Преподаватель читает лекцию, с использованием мультимедийного оборудования, с заранее запланированными ошибками которые должны обнаружить студенты. Список ошибок передается студентам в конце лекции. Подбираются наиболее распространенные ошибки, которые чаще всего делают студенты во время ответов. Студенты во время лекции должны обнаружить ошибки и занести	4

		их в конспект. В конце лекции проводится их обсуждение.	
Практические ситуационные задания	Практические занятия и семинары	На основе реальных данных с сайта Московской биржи ( <a href="http://www.moex.com">www.moex.com</a> ) сформировать портфель из акций пяти компаний с оптимальными характеристиками доходности и риска.	8

## Собственные инновационные способы и методы, используемые в образовательном процессе

Не предусмотрены

Использование результатов научных исследований, проводимых университетом, в рамках данной дисциплины: нет

## 7. Фонд оценочных средств (ФОС) для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины

### 7.1. Паспорт фонда оценочных средств

Наименование разделов дисциплины	Контролируемая компетенция ЗУНЫ	Вид контроля (включая текущий)	№№ заданий
Все разделы	ПК-32 способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	Проверка теоретического материала и решения задач, текущий	Задания для практических занятий и семинаров, самостоятельных работ представлены в методических указаниях дисциплины
Все разделы	ПК-34 способностью проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов	Проверка теоретического материала и решения задач, текущий	Задания для практических занятий и семинаров, самостоятельных работ представлены в методических указаниях дисциплины
Понятие финансового актива и его характеристики	ПК-32 способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	Проверка заданий: Задание1 (РГР1), Задание5 (РГР5), текущий	Задание1 (РГР1), Задание5 (РГР5)
Современная портфельная теория	ПК-32 способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	Проверка Задания 2 (РГР2) текущий	Задание 2 (РГР 2)
Модели и методы	ПК-32 способностью проводить	Проверка Задания	Задание 3 (РГР 3)

оценки финансовых активов	анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	3 (РГР3) текущий	
Показатели эффективности управления портфелем	ПК-32 способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	Проверка Задания 4 (РГР4) текущий	Задание 4 (РГР 4)
Все разделы	ПК-32 способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	экзамен	вопросы с 1-14, типовые задачи
Все разделы	ПК-34 способностью проводить комплексный анализ угроз экономической безопасности при планировании и осуществлении инновационных проектов	экзамен	вопросы с 15-27, типовые задачи

## 7.2. Виды контроля, процедуры проведения, критерии оценивания

Вид контроля	Процедуры проведения и оценивания	Критерии оценивания
экзамен	Экзамен проводится по билетам в письменной форме . В билете три вопроса: один теоретический вопрос и два практических задания. Каждому студенту задается по одному вопросу из любых трех тем, выносимых на экзамен. При неправильном ответе студенту могут быть заданы уточняющие или новые вопросы по этой теме. Тема считается освоенной, если студент смог ответить на 65% вопросов, заданных по этой теме	Отлично: если при устном опросе студент показывает глубокое знание вопросов темы, свободно оперирует экономическими терминами и понятиями дисциплины, легко и быстро отвечает на поставленные вопросы. В дополнение к этому студентом правильно (возможны небольшие недочеты, не влияющие на правильность решения) решены оба задания. Хорошо: если при устном опросе студент показывает знание вопросов темы, оперирует экономическими терминами и понятиями дисциплины, без особых затруднений отвечает на поставленные вопросы. В дополнение к этому студентом в общем правильно решены оба задания, хотя возможна некоторая неполнота решения и допущение неточностей. Удовлетворительно: если при устном опросе студент проявляет неуверенность,

		<p>показывает слабое знание вопросов темы, не всегда дает исчерпывающие аргументированные ответы на заданные вопросы. В дополнении к этому студентом правильно решено одно задание, второе задание выполнено со значительными ошибками или не выполнено вообще. Также оценка «Удовлетворительно» может быть выставлена, если у студента возникают трудности при ответе на вопросы устного этапа экзамена, но правильно (возможны небольшие недочеты, не влияющие на правильность решения) решены обе задания, предложенные на письменном этапе.</p> <p>Неудовлетворительно: если при устном опросе студент затрудняется отвечать на поставленные вопросы, не знает теории вопроса, при ответе допускает существенные ошибки. В дополнении к этому студентом не выполнено одно или оба предложенных на письменном этапе экзамена задания или выполнены со значительными ошибками.</p>
Проверка теоретического материала и решения задач, текущий	Студенту устно задаются вопросы по теоретическому материалу, изученному на лекционных и практических занятиях. Ответ считается зачтенным, если студент дал положительный ответ на вопросы, заданные по данным темам. На практических занятиях студенту выдаются задачи по данным темам. Задача считается решенной, если по ней получен правильный ответ и сделаны грамотные выводы.	<p>Зачтено: если при устном опросе студент показывает знание вопросов темы. Если студентом правильно решены задачи или решены с незначительными ошибками.</p> <p>Не зачтено: если при устном опросе студент затрудняется отвечать на поставленные вопросы, не знает теории вопроса, при ответе допускает существенные ошибки. Если студентом не решены задачи или решены со значительными ошибками.</p>
	Студенту предлагается выполнить расчетно-графическое задание (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела 1 данной рабочей программы.	<p>Отлично: Расчетная и графическая части выполнены верно, грамотно сформулированы выводы.</p> <p>Хорошо: Расчетная и графическая части выполнены верно, выводы сформулированы с неточностями и имеются недочеты не влияющие на конечный результат.</p> <p>Удовлетворительно: Расчетная и графическая части выполнены верно, но неверно сформулированы выводы, в графической и расчетной части имеются неточности и недочеты.</p> <p>Неудовлетворительно: В расчетной и графической частях есть грубые замечания, неверно сформулированы выводы.</p>

Проверка Задания 2 (РГР2) текущий	Студенту предлагается выполнить расчетно-графическое задание (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела 2 данной рабочей программы.	<p>Отлично: Расчетная и графическая части выполнены верно, грамотно сформулированы выводы.</p> <p>Хорошо: Расчетная и графическая части выполнены верно, выводы сформулированы с неточностями и имеются недочеты не влияющие на конечный результат.</p> <p>Удовлетворительно: Расчетная и графическая части выполнены верно, но неверно сформулированы выводы, в графической и расчетной части имеются неточности и недочеты.</p> <p>Неудовлетворительно: В расчетной и графической частях есть грубые замечания, неверно сформулированы выводы.</p>
Проверка Задания 3 (РГР3) текущий	Студенту предлагается выполнить расчетно-графическое задание (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела 4 данной рабочей программы.	<p>Отлично: Расчетная и графическая части выполнены верно, грамотно сформулированы выводы.</p> <p>Хорошо: Расчетная и графическая части выполнены верно, выводы сформулированы с неточностями и имеются недочеты не влияющие на конечный результат.</p> <p>Удовлетворительно: Расчетная и графическая части выполнены верно, но неверно сформулированы выводы, в графической и расчетной части имеются неточности и недочеты.</p> <p>Неудовлетворительно: В расчетной и графической частях есть грубые замечания, неверно сформулированы выводы.</p>
Проверка Задания 4 (РГР4) текущий	Студенту предлагается выполнить расчетно-графическое задание (см. вложенный файл) по итогам освоения Раздела 6 данной рабочей программы.	<p>Отлично: Расчетная и графическая части выполнены верно, грамотно сформулированы выводы.</p> <p>Хорошо: Расчетная и графическая части выполнены верно, выводы сформулированы с неточностями и имеются недочеты не влияющие на конечный результат.</p> <p>Удовлетворительно: Расчетная и графическая части выполнены верно, но неверно сформулированы выводы, в графической и расчетной части имеются неточности и недочеты.</p> <p>Неудовлетворительно: В расчетной и графической частях есть грубые замечания, неверно сформулированы выводы.</p>

### 7.3. Типовые контрольные задания

Вид контроля	Типовые контрольные задания
--------------	-----------------------------

экзамен	1. Понятие финансового актива и его характеристики. 2. Базовая модель оценки финансовых активов Дж. Уильямса. 3. Стоимость и доходность акций. 4. Стоимость и доходность облигаций. 5. Понятие риска. Виды риска. 6. Показатели риска акций и облигаций. 7. Понятие портфеля ценных бумаг. Виды портфелей ценных бумаг. 8. Показатели доходности и риска портфеля ценных бумаг. 9. Риск портфеля двух финансовых активов. Расчет риска портфеля двух финансовых активов: с корреляцией доходностей «+1» «-1». Графическое изображение. 10. Понятие эффективного и доминирующего портфеля. 11. Стратегия диверсификации Г. Марковица. 12. Понятие эффективной границы. 13. Модель оценки капитальных активов САРМ. 14. Линия рынка капитала. 15. Линия рынка актива. 16. Коэффициент систематического риска. 17. Сравнительный анализ CML и SML. Графическое изображение. 18. Альфа коэффициент. 19. Версия САРМ для облигаций. 20. Диагональная модель У. Шарпа. 21. Рыночная модель Джека Трейнора. 22. Многофакторные модели. 23. Модель Е.Фамы и К.Френча. 24. Модель арбитражного ценообразования С.Росса. 25. Показатели эффективности управления портфелем. 26. Стратегии в управление портфелем. Сравнительный анализ стратегий активного и пассивного управления портфелем финансовых активов. 27. Суть и виды стратегии активного управления портфелем финансовых активов. 28. Суть и виды стратегии пассивного управления портфелем финансовых активов.
Проверка теоретического материала и решения задач, текущий	Представлены в методических указаниях дисциплины
	РГР Задание1.doc; Задание 5.docx
Проверка Задания 2 (РГР2) текущий	РГР Задание2.doc
Проверка Задания 3 (РГР3) текущий	РГР Задание3.doc
Проверка Задания 4 (РГР4) текущий	РГР Задание 4.docx

## 8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

### Печатная учебно-методическая документация

a) основная литература:

1. Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций [Текст] А. С. Шапкин. - 6-е изд. - М.: Дашков и К, 2007. - 543 с. ил.

*б) дополнительная литература:*

1. Рынок ценных бумаг [Текст] учебник для вузов по экон. направлениям и специальностям А. Б. Басс и др.; под ред. Ю. А. Соколова ; Финанс. ун-т при Правительстве Рос. Федерации. - М.: Юрайт, 2014. - 383 с. ил.

*в) отечественные и зарубежные журналы по дисциплине, имеющиеся в библиотеке:*  
Не предусмотрены

*г) методические указания для студентов по освоению дисциплины:*

1. 1. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания к практическим занятиям / сост. С.В. Воронина под редакцией А.В. Карпушкиной. – Челябинск: Издательский центр ЮУрГУ, 2021. – 49 с.

*из них: учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студента:*

1. 1. Риски управления портфелем финансовых активов: методические указания к практическим занятиям / сост. С.В. Воронина под редакцией А.В. Карпушкиной. – Челябинск: Издательский центр ЮУрГУ, 2021. – 49 с.

### **Электронная учебно-методическая документация**

№	Вид литературы	Наименование ресурса в электронной форме	Библиографическое описание
1	Основная литература	Электронный каталог ЮУрГУ	Воронина, С. В. Риски управления портфелем финансовых активов метод. указания к практ. занятиям для студентов специальности 38.05.01 "Экон. безопасность" С. В. Воронина ; под ред. А. В. Карпушкиной ; Юж.-Урал. гос. ун-т, Каф. Экон. безопасность ; ЮУрГУ. - Челябинск: Издательский Центр ЮУрГУ, 2021. - 48, [1] с. ил. электрон. версия <a href="https://lib.susu.ru/Resursy/Elektronnye_resursy">https://lib.susu.ru/Resursy/Elektronnye_resursy</a>

### **9. Информационные технологии, используемые при осуществлении образовательного процесса**

Перечень используемого программного обеспечения:

1. Microsoft-Windows(бессрочно)

Перечень используемых информационных справочных систем:

1. ООО "ГарантУралСервис"-Гарант(31.12.2022)
2. -Консультант Плюс(31.07.2017)

## 10. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Вид занятий	№ ауд.	Основное оборудование, стенды, макеты, компьютерная техника, предустановленное программное обеспечение, используемое для различных видов занятий
Самостоятельная работа студента	126 (3б)	Компьютерное оборудование: Монитор 17" LCD Samsung – 15 шт., Многофункциональное устройство (принтер сканер, копир) МФУ Samsung SCX4100,A4 – 1 шт., Системный блок фронт Pentium2800/512Mb/ 80G/ SVGA LAN Sound int/FDD/300W – 14 шт., Видеокамера JVC EverinoGZ-MG77E – 1 шт., Мини-АТС Panasonic KX-TEM824RU – 1 шт., Видео-камера цифровая HDD JVC GZ-MG77E.Сж/д30Гб, с функцией создания DVD ч/з порт USB без ПК – 1 шт., Планшет графический WacomIntous3 – 1 шт., Принтер HP лазерный LaserJet P1505 (CB412A) (225*379*413мм) – 1 шт., Документ-камера – 1 шт., Проектор BenQ MP575 – 1 шт., Коммутатор D-Link DES-1016D – 1 шт., Акустическая система CAMERON ASHT-200 – 1 шт., Акустическая система CAMERON ASHT-200 – 1 шт., Микрофон Elenberg – 1 шт., Сканер CanonLide25 планшетный – 1 шт., Источник бесперебойного питания ИБП APC SC420I вертикальное исполнение – 3 шт. Программное обеспечение: Microsoft Windows 8 SP1 – 2 экз., Microsoft Windows 7 SP1 – 2 экз., Microsoft Windows Vista Starter – 1 экз., Microsoft Windows XP SP3 – 33 экз., Microsoft Windows Office Professional Plus 2007 Russian – 19 экз., SunRav TestOfficePro 5 – 1/32 экз., Консультант плюс – 1экз., Project Expert 7 Tutorial – 1/20 экз., 1C: Предприятие 8.1 – 2/40 экз., Windows Server 2008 Enterprise – 1 экз., NOD32 Antivirus System – 1экз.
Практические занятия и семинары	126 (3б)	Компьютерное оборудование: Монитор 17" LCD Samsung – 15 шт., Многофункциональное устройство (принтер сканер, копир) МФУ Samsung SCX4100,A4 – 1 шт., Системный блок фронт Pentium2800/512Mb/ 80G/ SVGA LAN Sound int/FDD/300W – 14 шт., Видеокамера JVC EverinoGZ-MG77E – 1 шт., Мини-АТС Panasonic KX-TEM824RU – 1 шт., Видео-камера цифровая HDD JVC GZ-MG77E.Сж/д30Гб, с функцией создания DVD ч/з порт USB без ПК – 1 шт., Планшет графический WacomIntous3 – 1 шт., Принтер HP лазерный LaserJet P1505 (CB412A) (225*379*413мм) – 1 шт., Документ-камера – 1 шт., Проектор BenQ MP575 – 1 шт., Коммутатор D-Link DES-1016D – 1 шт., Акустическая система CAMERON ASHT-200 – 1 шт., Акустическая система CAMERON ASHT-200 – 1 шт., Микрофон Elenberg – 1 шт., Сканер CanonLide25 планшетный – 1 шт., Источник бесперебойного питания ИБП APC SC420I вертикальное исполнение – 3 шт. Программное обеспечение: Microsoft Windows 8 SP1 – 2 экз., Microsoft Windows 7 SP1 – 2 экз., Microsoft Windows Vista Starter – 1 экз., Microsoft Windows XP SP3 – 33 экз., Microsoft Windows Office Professional Plus 2007 Russian – 19 экз., SunRav TestOfficePro 5 – 1/32 экз., Консультант плюс – 1экз., Project Expert 7 Tutorial – 1/20 экз., 1C: Предприятие 8.1 – 2/40 экз., Windows Server 2008 Enterprise – 1 экз., NOD32 Antivirus System – 1экз.
Контроль самостоятельной работы	126 (3б)	Компьютерное оборудование: Монитор 17" LCD Samsung – 15 шт., Многофункциональное устройство (принтер сканер, копир) МФУ Samsung SCX4100,A4 – 1 шт., Системный блок фронт Pentium2800/512Mb/ 80G/ SVGA LAN Sound int/FDD/300W – 14 шт., Видеокамера JVC EverinoGZ-MG77E – 1 шт., Мини-АТС Panasonic KX-TEM824RU – 1 шт., Видео-камера цифровая HDD JVC GZ-MG77E.Сж/д30Гб, с функцией создания DVD ч/з порт USB без ПК – 1 шт., Планшет графический WacomIntous3 – 1 шт., Принтер HP лазерный LaserJet P1505 (CB412A) (225*379*413мм) – 1 шт., Документ-камера – 1

		<p>шт., Проектор BenQ MP575 – 1 шт., Коммутатор D-Link DES-1016D – 1 шт., Акустическая система CAMERON ASHT-200 – 1 шт., Акустическая система CAMERON ASHT-200 – 1 шт., Микрофон Elenberg – 1 шт., Сканер CanonLide25 планшетный – 1 шт., Источник бесперебойного питания ИБП APC SC420I вертикальное исполнение – 3 шт.</p> <p>Программное обеспечение: Microsoft Windows 8 SP1 – 2 экз., Microsoft Windows 7 SP1 – 2 экз., Microsoft Windows Vista Starter – 1 экз., Microsoft Windows XP SP3 – 33 экз., Microsoft Windows Office Professional Plus 2007 Russian – 19 экз., SunRav TestOfficePro 5 – 1/32 экз., Консультант плюс – 1экз., Project Expert 7 Tutorial – 1/20 экз., 1С: Предприятие 8.1 – 2/40 экз., Windows Server 2008 Enterprise – 1 экз., NOD32 Antivirus System – 1экз.</p>
Экзамен	141 (3б)	Мультимедийный проектор, экран, компьютер, программное обеспечение.
Лекции	142 (3б)	Мультимедийный проектор, экран, компьютер, программное обеспечение