

АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

«Теория и практика управления финансовыми рисками»

Дисциплина «Теория и практика управления финансовыми рисками» является частью программы магистратуры «Оценка и управление стоимостью предприятия» по направлению «38.04.01 Экономика».

Цели и задачи дисциплины

Формирование базовых знаний в области управления финансовыми рисками отдельного субъекта хозяйствования, развитие умений и навыков в вопросах идентификации, анализа и оценки финансовых рисков в рыночной экономике и выборе обоснованных финансовых решений и методов управления рисками на основе базовых концепций риск-менеджмента..

Изучаемые объекты дисциплины

- риск-менеджмент; - кредитный риск; - валютный риск; - риск ликвидности; - инвестиционный риск..

Объем и виды учебной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах	
		Номер семестра	
		1	
1. Проведение учебных занятий (включая проведение текущего контроля успеваемости) в форме:	54	54	
1.1. Контактная аудиторная работа, из них:			
- лекции (Л)	14	14	
- лабораторные работы (ЛР)			
- практические занятия, семинары и (или) другие виды занятий семинарского типа (ПЗ)	36	36	
- контроль самостоятельной работы (КСР)	4	4	
- контрольная работа			
1.2. Самостоятельная работа студентов (СРС)	54	54	
2. Промежуточная аттестация			
Экзамен	36	36	
Дифференцированный зачет			
Зачет			
Курсовой проект (КП)			
Курсовая работа (КР)			
Общая трудоемкость дисциплины	144	144	

Краткое содержание дисциплины

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
	Л	ЛР	ПЗ	СРС
1-й семестр				

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
	Л	ЛР	ПЗ	СРС
Природа риска и классификация рисков.	2	0	8	12
Предмет, цели и задачи курса. Взаимосвязи анализа и управления рисками с другими дисциплинами. Понятие риска. Формы проявления риска. Природа риска: риски, обусловленные вероятностью, и риски, обусловленные неопределенностью. Предпринимательские и непредпринимательские риски. Многообразие финансовых рисков. Особенности классификации финансовых рисков. Основные элементы классификации рисков.				
Риск-менеджмент. Анализ и управление кредитными рисками.	4	0	8	14
Риск-менеджмент как процесс. Этапы риск-менеджмента: идентификация риска, анализ и количественная оценка рисков, управлением риском, контроль за риском. Принципы риск-менеджмента. Риск-менеджмент как новая философия стратегического управления в финансовом бизнесе. Понятие риск-капитала. Объективная необходимость осуществления риск-менеджмента. Прямое директивное управление рисками. Необходимые условия обеспечения эффективного риск-менеджмента. Лимитирование операций: понятие лимита, целесообразность применения лимитирования и различных ситуациях (stop-loss). Ограничение рисков путем оценки эффективности с учетом риска. Принципы построения системы контроля в банке. Основные методы анализа и оценки кредитоспособности заемщика (фундаментально-аналитический, количественно-статистический). Обеспечение кредитных сделок. Распределение (диверсификация), компенсация (хеджирование) и ограничение.				
Анализ и управление валютным риском и риском процентной ставки.	4	0	10	14
Виды рыночных рисков. Волатильность и способы ее моделирования. Структура валютного риска. Колебания курсов валют как основа существования валютного риска. Своп-риск. Риск фиксированной процентной ставки				

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
	Л	ЛР	ПЗ	СРС
(риск ФПС), риск плавающей процентной ставки (риск ППС). Основные подходы к анализу и количественной оценке риска процентной ставки: баланс связанности, анализ дюрации, баланс эластичности. Инструменты управления риском процентной ставки: futures, options, forward rate agreement.				
Анализ и управление риском ликвидности и риском инвестиционных проектов.	4	0	10	14
Понятие риска ликвидности. Источники возникновения риска ликвидности. Структура риска ликвидности. Основные направления минимизации риска ликвидности. Профиль риска инвестиционных проектов. Источники возникновения рисков инвестиционных проектов. Анализ и оценка рисков инвестиционных проектов. Управление рисками инвестиционных проектов. Страхование рисков инвестиционных проектов.				
ИТОГО по 1-му семестру	14	0	36	54
ИТОГО по дисциплине	14	0	36	54