

## АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

### «Управление финансовыми рисками»

Дисциплина «Управление финансовыми рисками» является частью программы бакалавриата «Экономика (общий профиль, СУОС)» по направлению «38.03.01 Экономика».

#### Цели и задачи дисциплины

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

#### Изучаемые объекты дисциплины

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

#### Объем и виды учебной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах	
		Номер семестра	
		6	
1. Проведение учебных занятий (включая проведение текущего контроля успеваемости) в форме:	58	58	
1.1. Контактная аудиторная работа, из них:			
- лекции (Л)	24	24	
- лабораторные работы (ЛР)			
- практические занятия, семинары и (или) другие виды занятий семинарского типа (ПЗ)	30	30	
- контроль самостоятельной работы (КСР)	4	4	
- контрольная работа			
1.2. Самостоятельная работа студентов (СРС)	86	86	
2. Промежуточная аттестация			
Экзамен	36	36	
Дифференцированный зачет			
Зачет			
Курсовой проект (КП)			
Курсовая работа (КР)			
Общая трудоемкость дисциплины	180	180	

#### 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
6-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
Модуль 1. Классификация и виды финансовых рисков.	12	0	12	44
<p>Тема 1. Теоретические основы финансовых рисков.  Место и роль рисков в экономической деятельности. Понятие риска как экономической категории. Причины и источники возникновения финансовых рисков. Неопределенность и риск, их свойства и отличительные особенности. Сущность риска. Функции риска в экономике. Историческое развитие взглядов ведущих экономистов на понятие риска и его роль в экономике. Основные научные концепции риска. Взаимосвязь максимизации прибыли, новаторства, неопределенности и риска. Отношение к риску классической, неоклассической и маржиналистской экономических школ. Психическое восприятие риска. Выбор решения с учетом склонности к риску и ожидаемой полезности. Проблемы риска в экономике России.</p> <p>Тема 2. Классификация и виды финансовых рисков.  Анализ внешней и внутренней среды организации, выявление факторов риска. Ранние и современные классификации рисков. Чистые и спекулятивные риски. Диверсифицируемые и недиверсифицируемые риски. Рыночные риски. Допустимый риск, критический риск и катастрофический риск. Прогнозируемые и непрогнозируемые, страхуемые и нестрахуемые риски. Общие и специфические риски. Классификация рисков по причине возникновения. Операционные риски, риски в сфере производства. Инвестиционные и инновационные риски. Реализуемость различных видов рисков для различных направлений деятельности (производственные структуры, торговые структуры, финансовые структуры, участники рынка ценных бумаг).</p>				
Модуль 2. Методы анализа и оценки риска. Управление финансовыми рисками.	12	0	18	42
Тема 3. Методы анализа и оценки риска. Идентификация (диагностика) рисков				

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
	Л	ЛР	ПЗ	СРС
<p>компании. Этапы идентификации рисков. Качественные методы анализа и оценки рисков. Картографирование, ранжирование рисков, выделение критических рисков. Экспертные процедуры и методы субъективных оценок при прогнозировании и измерении риска. Шкалы риска и характеристика их градаций. Карты и матрицы рисков. Количественные методы оценки рисков. Кумулятивная модель. Модель CAPM. Модель WACC. Вероятностные и статистические методы оценки рисков. Показатели чувствительности. Расчетно-аналитический метод. Коэффициент риска. Метод дерева решений.</p> <p>Тема 4. Методы управленческого воздействия на финансовые риски. Аутсорсинг, аутстаффинг, факторинг как способы передачи рисков. Методы компенсации рисков. Самострахование. Создание системы резервов внутри предприятия. Принятие решений в условиях частичной неопределенности. Интегрированный риск-менеджмент. Процессный подход в управлении рисками. Стратегия и тактика риск-менеджмента. Бизнес-процессы и связанные с ними процедуры анализа и контроля рисков. Оценка результатов деятельности компании с учетом риска: показатели RI, EVA. Инструменты бережливого производства для тактического риск-менеджмента.</p>				
ИТОГО по 6-му семестру	24	0	30	86
ИТОГО по дисциплине	24	0	30	86