

АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

«Управление рисками»

Дисциплина «Управление рисками» является частью программы бакалавриата «Прикладная информатика (общий профиль, СУОС)» по направлению «09.03.03 Прикладная информатика».

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; валютный риск; риск ликвидности; инвестиционный риск..

Объем и виды учебной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах	
		Номер семестра	
		7	
1. Проведение учебных занятий (включая проведение текущего контроля успеваемости) в форме:	72	72	
1.1. Контактная аудиторная работа, из них:			
- лекции (Л)	32	32	
- 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)	72	72	
2. Промежуточная аттестация			
Экзамен			
Дифференцированный зачет	9	9	
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
7-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
Анализ и управление валютным риском и риском процентной ставки.	8	0	10	18
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 (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, forwardrateagreement.				
Риск-менеджмент. Анализ и управление кредитными рисками.	8	0	8	18
Риск-менеджмент как процесс. Этапы риск-менеджмента: идентификация риска, анализ и количественная оценка риска, управление риском, контроль за риском. Принципы риск-менеджмента. Риск-менеджмент как новая философия стратегического управления в проектном 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 в 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 риском ликвидности и риском инвестиционных проектов.	8	0	10	18
Понятие риска ликвидности. Источники возникновения риска ликвидности. Структура риска ликвидности. Основные направления минимизации риска ликвидности. Профиль риска				

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
	Л	ЛР	ПЗ	СРС
инвестиционных проектов. Источники возникновения рисков инвестиционных проектов. Анализ и оценка рисков инвестиционных проектов. Управление рисками инвестиционных проектов. Страхование рисков инвестиционных проектов.				
Природа и классификация рисков.	8	0	8	18
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.				
ИТОГО по 7-му семестру	32	0	36	72
ИТОГО по дисциплине	32	0	36	72