

## АННОТАЦИЯ

дисциплины Б1.В.ДВ.12.02 «Финансовые риски»

**Объем трудоемкости:** 4 зачетные единицы (144 ч., из них – 54,3 ч. контактной работы: лекционных 16 ч., практических 32 ч., иной контактной работы 0,3 ч. КСР 6ч.; само- стоятельной работы 63 ч.; контроль 26,7 ч.).

### Цель дисциплины:

Целью дисциплины «Финансовые риски» является формирование целостного представления о функционировании экономической системы в условиях неопределенности, о содержании организационной и методической деятельности коммерческих структур в области выявления, анализа, выбора метода воздействия и контроля финансовых рисков в ходе оценки и совершенствования предлагаемых вариантов управленческих решений.

### Задачи дисциплины:

- изучение закономерностей, причин возникновения и сущности финансовых рисков;
- изучение методов и инструментов идентификации, анализа и контроля системы финансовых рисков организации;
- изучение методов оценки влияния финансовых рисков на результаты деятельности коммерческих структур;
- изучение подходов к выбору вариантов управленческих решений на основе критериев социально-экономической эффективности с учетом рисков и возможных социально-экономических последствий принимаемых решений.

### Место дисциплины в структуре ООП ВО

Дисциплина входит в вариативную часть части Блока 1 учебного плана профиля «Финансы и кредит».

Дисциплина «Финансовые риски» включает в себя совокупность положений в области теории и практики управления финансовыми рисками. В курсе " Финансовые риски» излагается сущность финансового риска, рассматриваются факторы, влияющие на уровень риска, даются методы количественной оценки экономического риска, приводятся практические примеры принятия эффективных решений в условиях риска для конкретных экономических ситуаций. Специфика курса «Финансовые риски» состоит, прежде всего, в изучении возможностей экономического анализа, в котором проблема оценки и учета финансового риска приобретает самостоятельное теоретическое и, главное, прикладное значение как важная часть менеджмента, теории и практики управления.

В ходе освоения дисциплины «Финансовые риски» студент должен опираться на знания и умения, полученные в результате освоения дисциплин «Статистика», «Математика», «Финансы», в частности на умение проводить статистический анализ данных, использовать различные методы оценки взаимосвязи изучаемых признаков, знание различных терминов и показателей экономики организаций. В результате изучения дисциплины «Финансовые риски» студенты осваивают положения теории и практические навыки в области управления рисками. Знания, умения и навыки, освоенные студентами применяются в ходе написания выпускной квалификационной работы.

### Требования к уровню освоения дисциплины

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных компетенций

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1.	ПК-11	способностью критически оценить предлагаемые варианты управленческих	- методы выявления, анализа, выбора метода воздействия и	- обосновывать выбор управленческих решений на основе оценки	- основными методами снижения финансовых рисков и

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
		решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий	контроля финансовых рисков в ходе оценки и совершенствования предлагаемых вариантов управленческих решений .	влияния финансовых рисков; - минимизировать финансовые рисками и их экономические последствия.	управления рисками.

### Основные разделы дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в 8 семестре

№	Наименование разделов (тем)	Всего	Количество часов			
			Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1	2	3	4	5	6	7
1.	← Сущность и функции финансового риска	13	2	4	–	7
2.	← Методы выявления, анализа, выбора метода воздействия и контроля финансовых рисков	18	2	4	–	12
3.	← Финансовый риск-менеджмент в компаниях реального сектора экономики	24	4	8	–	12
4.	Финансовый риск-менеджмент в банках	16	2	4	–	10
5.	Финансовый риск-менеджмент в страховых компаниях	16	2	4	–	10
6.	Финансовый риск-менеджмент профессиональных участников рынка ценных бумаг	24	4	8	–	12
<i>Итого по дисциплине:</i>			16	32	–	63

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия/семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

**Курсовые работы:** не предусмотрены

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** экзамен

**Основная литература:**

1. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / И. П. Хоминич [и др.] ; под ред. И. П. Хоминич, И. В. Пещанской. — М. : Издательство Юрайт, 2018. — 345 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01019-0. — Режим доступа : [www.biblio-online.ru/book/419260FD-3B72-4848-A8C3-B8EBAVF94F86](http://www.biblio-online.ru/book/419260FD-3B72-4848-A8C3-B8EBAVF94F86).

1. Шапкин, А.С. Экономические и финансовые риски: Оценка, управление, портфель инвестиций [Электронный ресурс] : учебное пособие / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2016. — 544 с. — Режим доступа: <http://e.lanbook.com/book/93337>. — Загл. с экрана.

Автор РПД  
к-т экон. наук, доцент

: Соколова Н.В., доцент кафедры ЭАСиФ,