

Аннотация
дисциплины «Б1.В.19 Финансовые риски»
Направление подготовки 38.03.01 Экономика
Направленность (профиль) Финансы и кредит

Объем трудоемкости: 2 зачетные единицы, 72 часа

Цели дисциплины

Изучение курса «Финансовые риски» имеет следующие цели:

1. Раскрыть теоретические основы финансовых рисков, рассмотреть как классические, так и новые принципы, характеризующие риски в экономике в целом и в финансовой сфере в частности.

2. Познакомиться с методами оценки финансовых рисков, факторами и показателями, характеризующими рискованность различных финансовых активов.

3. Показать возможные подходы к организации и управлению финансовыми рисками, сравнить их достоинства и недостатки.

Задачи дисциплины:

- ознакомить с понятиями, классификацией рисков в современной экономике;

- показать место финансовых рисков в экономике, их классификацию;

- раскрыть общие принципы организации риск-менеджмента;

- рассмотреть и сравнить общие методы и показатели, применяемые для оценки экономических рисков;

- дать систему показателей оценки финансовых рисков (вероятность, ожидаемая доходность, стандартное отклонение, др.);

- охарактеризовать финансовые активы;

- рассмотреть подходы и модели в оценке финансовых рисков

- рассмотреть принципы организации управления финансовыми рисками;

- охарактеризовать и сравнить подходы и методы управления финансовыми рисками: лимитирование, диверсификация, страхование, управление активами и пассивами, срочные контракты (фьючерсы, опционы), другие.

Место дисциплины в структуре ООП ВО

Дисциплина «Финансовые риски» входит в блок Б.1 (Вариативная часть), обязательная дисциплина по выбору

Дисциплина «Экономическая безопасность» относится к вариативной части общенаучного цикла основной образовательной программы подготовки бакалавров по направлению "Экономика".

В ходе изучения дисциплины студенты должны иметь знания, навыки и умения, полученные при изучении дисциплин: «Статистика», «Высшая математика», «Эконометрика», «Микроэкономика», «Макроэкономика» и блока специальных дисциплин.

Требования к результатам освоения дисциплины.

Изучение дисциплины «**Финансовые риски**» направлено на формирование следующих компетенций: ОК-6; ОПК-3; ОПК-4; ПК-1; ПК-8

Основные разделы дисциплины:

| № раздела | Наименование раздела | Количество часов | | | | |
|-----------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|-------------------|-----------|----------|------------------------|
| | | Всего | Контактная работа | | | Самостоятельная работа |
| | | | Л | ПЗ | ЛР | |
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
| Раздел 1 | Сущность, содержание и функции управления финансовым риском в рыночной экономике. Виды финансовых рисков. | 17 | 2,5 | 2,5 | | 12 |
| Раздел 2 | Содержание приемов и методов управления финансовым риском. | 17 | 2,5 | 2,5 | | 12 |
| Раздел 3 | Процесс идентификации финансовых рисков. Стратегия и тактика управления финансовыми рисками. | 17 | 2,5 | 2,5 | | 12 |
| Раздел 4 | Анализ эффективности страхования и самострахования как двух главных методов управления финансовыми рисками. | 17 | 2,5 | 2,5 | | 11,8 |
| | Всего | 72 | 10 | 10 | 0 | 47,8 |

Курсовые работы: не предусмотрены

Форма проведения аттестации по дисциплине: зачет на 4 курсе

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. - Москва : Юрайт, 2019. - 345 с. - (Бакалавр и магистр. Академический курс). - URL: <https://biblio-online.ru/viewer/upravlenie-finansovymi-riskami-433674#page/1> .
2. Пименов, Н. А. Управление финансовыми рисками в системе экономической безопасности : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. А. Пименов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 326 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-04539-0. —URL: <https://biblio-online.ru/book/upravlenie-finansovymi-riskami-v-sisteme-ekonomicheskoy-bezopasnosti-432108>
3. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 365 с. — (Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-3502-8. - URL: <https://biblio-online.ru/book/risk-menedzhment-432176>