

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

Объем трудоемкости: 2 зачетные единицы, 72 часов

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	4	4		9
Раздел 2	Содержание приемов и методов управления финансовым риском.	17	4	4		9
Раздел 3	Процесс идентификации финансовых рисков. Стратегия и тактика управления финансовыми рисками.	17	4	4		9
Раздел 4	Анализ эффективности страхования и самострахования как двух главных методов управления финансовыми рисками.	17	4	4		9
	Всего	72	16	16	0	35,8

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. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 345 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-01019-0. ЭБС: URL: <https://www.biblio-online.ru/viewer/419260FD-3B72-4848-A8C3-B8EBAVF94F86#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. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 326 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-04539-0. ЭБС: URL <https://www.biblio-online.ru/viewer/2F733C7A-FD67-4303-BE6A-CBA46B198EAB#page/1>

3. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 414 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00945-3. ЭБС: URL <https://www.biblio-online.ru/viewer/E098C311-CAA9-4FD5-AC72-5F801419DD64#page/1>

4. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 365 с. — (Серия : Авторский учебник). — ISBN 978-5-9916-3502-8. ЭБС: URL <https://www.biblio-online.ru/viewer/4627F69F-8A78-4F2B-BA77-0FBA1599D0AC#page/1>

5. Основы риск-менеджмента / Д. Гэлаи, М. Кроуи, В. Б. Минасян, Р. Марк. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 390 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-02578-1. ЭБС: URL: <https://www.biblio-online.ru/viewer/B09D2080-475C-4D6A-A567-EC01EE10B8CD#page/1>