

**АННОТАЦИЯ**  
**дисциплины «Б1.В.21 Риск-менеджмент»**  
**Направление подготовки 38.03.01 Экономика**  
**Направленность (профиль) Финансы и кредит**

**Объем трудоемкости:** 3 зачетные единицы, 108 часов

**Цель дисциплины:** является понимание природы финансовых рисков, знание методов их оценки и подходов к управлению ими (снижения их последствий и уменьшения вероятности их наступления) выступает важным фактором эффективности финансово-хозяйственной деятельности в современной экономике, изучение методов оценки финансовых рисков, факторов и показателей, характеризующих рискованность различных финансовых активов

**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.

**Место дисциплины в структуре ООП ВО:** Общая трудоёмкость дисциплины 2 зачётных единицы. В рамках изучения дисциплины «Финансовые риски» излагается материал, позволяющий узнать, какие финансовые риски наиболее актуальны, как их можно оценить и измерить и какие подходы (методы) следует использовать для снижения вероятности их возникновения и уменьшения возникающих после их реализации убытков и т.д.

Для изучения дисциплины необходимо знания, сформированные в результате освоения таких дисциплин, как:

- Макроэкономика;
- Микроэкономика;
- Теория вероятностей и математическая статистика.

**Требования к уровню освоения дисциплины**

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся общекультурных/общепрофессиональных/профессиональных компетенции: ОК-6, ОПК-3, ОПК-4, ПК-1 и 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	4,5		6
Раздел 2	Содержание приемов и методов управления финансовым риском.	17	2,5	4,5		12
Раздел 3	Процесс идентификации финансовых рисков. Стратегия и тактика управления финансовыми рисками.	17	2,5	6,5		10
Раздел 4	Анализ эффективности страхования и самострахования как двух главных методов управления финансовыми рисками.	17	4,5	6,5		12
	<b>Всего</b>	<b>72</b>	<b>12</b>	<b>24</b>	<b>0</b>	<b>40</b>

**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, 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-B8EBABF94F86#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. Управление финансовыми рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / И. П. Хоминич [и др.] ; под редакцией И. П. Хоминич, И. В. Пещанской. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 345 с. // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL:<https://www.biblio-online.ru/bcode/433674>