

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.ДВ.10.01 «ФИНАНСОВЫЙ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ»

Для подготовки бакалавров по направлению 38.03.01 «Экономика»
(профиль «Финансы и кредит»)

(Аннотация)

Цель преподавания учебной дисциплины: дать обучающимся систематизированные знания по актуальным теоретическим и практическим проблемам разработки финансового риск-менеджмента, сформировать профессиональные представления в области использования методического инструментария для оценки финансовых рисков и возможных социально-экономических последствий, умения и навыки в разработке мер по нейтрализации факторов с учетом различных рискованных ситуаций.

Компетенции студента, формируемые в результате освоения дисциплины

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции ПК-21. В результате освоения компетенций студент должен:

знать:

- различные методы и инструменты управления финансовыми рисками - ПК-21-31;
- природу и классификацию финансовых рисков для развития предпринимательской деятельности - ПК-21-32;
- механизм функционирования и применения инструментов управления финансовыми рисками - ПК-21-33;
- основные концепции и теории риск-менеджмента и антикризисного управления - ПК-21-34.

уметь:

- оценивать воздействие системы управления финансовыми рисками на результаты деятельности организации - ПК-21-У1;
- составлять финансовые планы организации, обеспечивать осуществление финансовых взаимоотношений с организациями, органами государственной власти и местного самоуправления - ПК-21-У2;
- осуществлять анализ и разработку стратегии риск-менеджмента и антикризисного управления организации на основе современных методов и передовых научных достижений - ПК-21-У3.

владеть:

- навыками для анализа и оценки механизма использования эффективных методов финансовых рисков - ПК-21-В1;
- основными концепциями по разработке механизмов способствующих снижению финансовых рисков ПК-21-В2;
- методиками составления финансовых планов организации, обеспечивать осуществление финансовых взаимоотношений с организациями - ПК-21-В3;
- механизмами управления финансовой деятельностью организации - ПК-21-В4.

Содержание дисциплины:

Понятие и сущность финансовых рисков. Стоимость и доходность финансовых активов. Риск-менеджмент как система управления финансовыми рисками. Методический инструментарий учета фактора риска в финансовых операциях. Производные финансовые инструменты в финансовой системе. Управление рыночными рисками. Управление рыночным риском портфеля производных финансовых инструментов. Управление кредитными рисками. Кредитные производные инструменты. Оценка уровня ликвидности и платежеспособности хозяйствующего субъекта. Управление операционными рисками. Содержание странового риска и методы его оценки.