

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»
(РУТ (МИИТ))

АННОТАЦИЯ К
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Управление экономическими рисками

Направление подготовки: 38.04.01 – Экономика

Направленность (профиль): Финансовая экономика

Форма обучения: Заочная

Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целью освоения учебной дисциплины «Управление экономическими рисками» является: овладение комплексом знаний, умений и навыков в области управления финансовыми рисками.

Исходя из цели, в процессе изучения дисциплины решаются следующие задачи:

- 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 (портфельный анализ, кривые безразличия при инвестировании, модель оценки финансовых активов, VaR, дюрация, др.);

- 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.

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 3 зачетных единиц (108 академических часа(ов)).