

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

УТВЕРЖДАЮ:

Директор РОАТ



В.И. Апатцев

29 мая 2018 г.



Кафедра «Экономика, финансы и управление на транспорте»

Автор Сертакова Евгения Николаевна, старший преподаватель

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

«Финансовые риски»

| | |
|--------------------------|-----------------------------|
| Направление подготовки: | <u>38.03.01 – Экономика</u> |
| Профиль: | <u>Финансы и кредит</u> |
| Квалификация выпускника: | <u>Бакалавр</u> |
| Форма обучения: | <u>заочная</u> |
| Год начала подготовки | <u>2018</u> |

| | |
|---|--|
| <p style="text-align: center;">Одобрено на заседании Учебно-методической комиссии института Протокол № 2 22 мая 2018 г. Председатель учебно-методической комиссии</p>  <p style="text-align: right;">С.Н. Климов</p> | <p style="text-align: center;">Одобрено на заседании кафедры</p> <p>Протокол № 16 15 мая 2018 г. Заведующий кафедрой</p>  <p style="text-align: right;">Л.В. Шкурина</p> |
|---|--|

1. Цели освоения учебной дисциплины

Целью освоения учебной дисциплины «Финансовые риски» является формирование у обучающихся компетенций в соответствии с требованиями федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 "Экономика", а также формирование у студентов современных фундаментальных знаний в области управления финансовыми рисками экономических субъектов.

2. Место учебной дисциплины в структуре ОП ВО

Учебная дисциплина "Финансовые риски" относится к блоку 1 "Дисциплины (модули)" и входит в его вариативную часть.

3. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

| | |
|-------|--|
| ОПК-4 | способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовность нести за них ответственность |
| ПК-5 | способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений |

4. Общая трудоемкость дисциплины составляет

2 зачетные единицы (72 ак. ч.).

5. Образовательные технологии

Образовательные технологии, используемые при обучении по дисциплине, направлены на реализацию компетентностного подхода и широкое использование в учебном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий в сочетании с внеаудиторной работой с целью формирования и развития профессиональных навыков студентов. При выборе образовательных технологий традиционно используется: 1. лекционно-семинарская зачетная система: проведение лекций, практических занятий, прием зачета; 2. проблемное обучение: проведение деловой игры; 3. система инновационной оценки «портфолио» - создание портфолио студентов в сети Интернет. При изучении дисциплины могут использоваться технологии электронного обучения (информационные, интернет ресурсы, вычислительная техника) и, при необходимости, дистанционные образовательные технологии, реализуемые в основном с применением информационно-телекоммуникационных сетей при опосредованном (на расстоянии) взаимодействии обучающегося и педагогических работников..

6. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам)

РАЗДЕЛ 1

Раздел 1. Понятие и сущность финансовых рисков как объекта риск-менеджмента

Риск как экономическая категория. Особенности риска.

Различные определения финансового риска. Сущность финансового риска. Объективная и субъективная основа финансового риска. Финансовые риски в внутри финансовой деятельности фирмы. Финансовые риски и внешняя финансовая среда деятельности фирмы.

Классификация видов финансовых рисков.

РАЗДЕЛ 1

Раздел 1. Понятие и сущность финансовых рисков как объекта риск-менеджмента

Опрос

РАЗДЕЛ 2

Раздел 2. Методология риск-менеджмента.

Методологические основы управления рисками в экономике. Риск-менеджмент. Стратегия. Тактика. Объект управления. Субъект управления. Функции. Схема управления рисками. Основные этапы процесса управления риском. Концепции управления рисками. Структура службы риск-менеджмента.

РАЗДЕЛ 2

Раздел 2. Методология риск-менеджмента.

Опрос

РАЗДЕЛ 3

Раздел 3. Оценка финансовых рисков.

Классификация методов оценки и анализа финансовых рисков.

Количественные методы оценки и анализа финансовых рисков:

методы математической статистики: метод математического ожидания, метод стандартного отклонения, метод коэффициента вариации, методы корреляционно-регрессионного анализа, метод анализа безубыточности, метод анализа чувствительности, метод анализа сценариев, методы многофакторного анализа.

Качественные методы оценки и анализа финансовых рисков: экспертные методы оценки, метод рейтинговых оценок, метод «Due Diligence», метод «дерево решений», метод построения «дерева событий».

Комбинированные качественно-количественные методы оценки и анализа финансовых рисков: методы имитационного моделирования, метод Дельфи, метод «Монте-Карло».

РАЗДЕЛ 3

Раздел 3. Оценка финансовых рисков.

Опрос, решение ситуационных задач

РАЗДЕЛ 4

Раздел 4. Методы управления финансовыми рисками.

Методы трансформации рисков. Отказ от риска. Снижение вероятности ущерба или предотвращение убытка. Уменьшение размера убытков. Разделение риска (дифференциация и дублирование). Аутсорсинг риска. Методы финансирования рисков.

РАЗДЕЛ 4

Раздел 4. Методы управления финансовыми рисками.

Опрос

РАЗДЕЛ 5

Раздел 5. Хеджирование финансовых рисков с использованием производных финансовых

инструментов.

Классификация производных финансовых инструментов как методов управления финансовыми рисками: опционы, форварды, фьючерсы, свопы и другие финансово – кредитные деривативы.

Сущность и виды хеджирования. Основные виды стратегий хеджирования и биржевая спекуляция.

РАЗДЕЛ 5

Раздел 5. Хеджирование финансовых рисков с использованием производных финансовых инструментов.

Опрос

Зачет

Зачет

Зачет

Зачет