Дисциплина: Управление финансовыми рисками

Аннотация

Трудоемкость: 4 ECTS, 144 академических часа.

Форма итогового контроля: экзамен

Краткое описание содержания дисциплины

Дисциплина охватывает одну из основных функций финансов, а именно управление рисками. Большая часть роли финансов - посвящена управлению, контролю и получению прибыли от риска. Эта дисциплина показывает, почему и как фирмы управляют своими рисками.

Современный подход состоит в том, чтобы рассматривать финансовую функцию как активно формулирующую политику и непосредственно участвующую в принятии последующих решений. Управление рисками включает обработку бизнес решений, связанных с финансовыми рисками.

Курс развивает концептуальную основу для размышлений о финансовых рисках и показывает, как эти концепции реализуются на практике в различных контекстах. В результате изучения предмета студенты должны получить знания, необходимые для понимания целей и мероприятий правительства, оценки возможных последствий для финансовой сферы и экономики в целом.

Программа курса «Количественные методы и управление рискам» содержит практический и теоретический анализ проблем количественного анализа и управления рисками, предусмотренных для изучения студентами III курсов экономического факультета по специальности «Экономика» (бакалавриат). Дисциплина рассчитана на 72 академических часа, из которых 36 – аудиторных (12 часов лекций и 12 часов – семинарских занятий), а также самостоятельной работы студентов с последующим контролем – 36 часа.

На лекциях предполагается изложение теоретических основ количественного анализа и управления рисками, а также подробный и практический анализ опыта управления рисками как предприятиями, так и на макро уровнях.

Семинарские занятия включают в себя две основные составляющие: тестирования, которое направлено на проверку теоретических знаний в области изучаемой дисциплины, а также различного рода практических заданий, несущих в себе цель дать студентам практические исследовательские навыки. В частности, во второй блок входит подготовка презентаций на заданные темы, работа в группе, дискуссии, решение практических задач риск менеджмента, визуализация и презентация количественного анализа.

Студентам предоставляется помощь в самостоятельном изучении материала, проводится дополнительное разъяснение наиболее трудных вопросов в индивидуальном порядке. В самостоятельную работу студентов входит исследовательская деятельность, подготовка презентаций, работа в группе, ознакомление с аналитическими материалами в рамках дисциплины, выполнение домашних заданий в процессе подготовки к семинарским занятиям и т.д..