

Б1.В.ОД.1 «Финансовый риск-менеджмент»

Цели дисциплины: формирование у магистрантов базовых знаний в области финансового риск-менеджмента, практических навыков по использованию современных методов оценки уровня финансовых рисков организаций, включая финансово-кредитных, представлений о современных практиках управления финансовыми рисками с целью их нейтрализации.

Задачи дисциплины:

- формирование комплекса теоретических знаний, необходимых для финансовых решений в условиях неопределённости;
- получение практических навыков оценки уровня финансовых рисков, возникающих при принятии финансовых решений;
- овладение методами управления финансовыми рисками и инструментов реализации решений по управлению финансовыми рисками организаций, включая финансово-кредитных;
- получение системы знаний лучших практик управления финансовыми рисками организаций, включая финансово-кредитных;
- формирование понимания морально-этических проблем при принятии решений в области управления финансовыми рисками и способах их разрешения;
- способности разрабатывать комплексные системы управления финансовыми рисками организаций и оценивать эффективность их функционирования.

Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Финансовый риск-менеджмент» относится к вариативной части учебного плана.

Дисциплина основывается на знании следующих дисциплин: «Актуальные проблемы финансов», Методология и методы исследований». Для успешного освоения дисциплины «Финансовый риск-менеджмент» студент должен:

1. Знать:
 - актуальные научные проблемы в области финансов и кредита (ПК-21);
 - эффективные направления финансового обеспечения инновационного развития на микро-, мезо- и макроуровне (ПК-22);
 - анализировать финансовые риски организаций (ОК-1).
2. Уметь:
 - выявлять и проводить исследование актуальных научных проблем в области управления финансовыми рисками организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитных (ПК-21);
 - осуществлять сбор, обработку, анализ и систематизацию информации по теме исследования, выбор методов и средств решения задач исследования (ПК-19);
 - провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- мезоуровне (ПК-4).
3. Владеть навыками:
 - разработки планов и программ проведения научных исследований в области управления финансовыми рисками (ПК-17);

- способностью осуществлять разработку моделей управления финансовыми рисками, давать оценку и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты (ПК-20);

- способность осуществлять разработку инструментов проведения исследований в области управления финансовыми рисками, анализ их результатов, подготовку данных для составления финансовых обзоров, отчетов и научных публикаций (ПК-18).

Требования к результатам освоения дисциплины:

В результате освоения дисциплины должны быть сформированы следующие компетенции:

ПК-5 - способностью на основе комплексного экономического и финансового анализа дать оценку результатов и эффективности финансово-хозяйственной деятельности организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные, органов государственной власти и местного самоуправления.

В результате освоения компетенции **ПК - 5** студент должен:

1. Знать:

- систему формирования экономических показателей оценки результатов эффективности финансово-хозяйственной деятельности организаций, оценки уровня финансовых рисков;

- влияние основных факторов рыночного равновесия на управление финансовыми рисками организаций;

- систему факторов и резервов повышения эффективности финансово – хозяйственной деятельности организаций различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные.

2. Уметь:

- выявлять проблемы в управлении финансами организаций;

- анализировать нормы действующего законодательства и правильно их толковать.

3. Владеть:

- навыками разработки управленческих решений в управлении финансовыми рисками по результатам проведённого комплексного экономического и финансового анализа.

ПК-6- способностью дать оценку текущей, кратко - и долгосрочной финансовой устойчивости организации, в том числе кредитной.

В результате освоения компетенции **ПК – 6** студент должен:

1. Знать:

- показатели оценки финансовой устойчивости организаций в том числе финансово кредитных;

2. Уметь:

- выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в текущей, кратко- и долгосрочной деятельности финансово-экономических субъектов.

3. Владеть:

- методами учёта финансово-экономических рисков и способами снижения степени риска.

ПК-22 способность выявлять и проводить исследование эффективных направлений финансового обеспечения инновационного развития на микро-, мезо- и макро- уровне.

В результате освоения компетенции **ПК - 22** студент должен:

1. Знать:

- эффективные направления финансового обеспечения инновационного развития на микро-, мезо- и макроуровне с учетом влияния финансовых рисков.

2. Уметь:

- выявлять и проводить исследование эффективных направлений финансового обеспечения инновационного развития на микро-, мезо- и макроуровне с учетом действующих методов снижения финансовых рисков.

3. Владеть:

- навыками анализа и оценки современных проблем инновационного развития организаций, включая финансово-кредитных.

ПК-23 - способностью выявлять и проводить исследование финансово – экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками.

В результате освоения компетенции **ПК – 23** студент должен:

1. Знать:

- способы оценки финансовых рисков;
- основные принципы и этапы управления финансовыми рисками;
- основные методы и пути снижения финансовых рисков;

2. Уметь:

- выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности организаций.

3. Владеть:

- методами сбора и анализа информации при идентификации финансовых рисков;
- способностью оценивать финансовые риски;
- способностью выполнять оценку финансовых рисков на автоматизированных системах.

ПК-24 - способностью проводить исследование проблем финансовой устойчивости организаций, в том числе финансово-кредитных, для разработки эффективных методов её обеспечения с учётом фактора неопределённости.

В результате освоения компетенции **ПК - 24** студент должен:

1. Знать:

- проблемы финансовой устойчивости организаций, в том числе финансово-кредитных.

2. Уметь:

- выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности организаций, в том числе финансово-кредитных.

3. Владеть:

- методами укрепления финансовой устойчивости организаций, в том числе финансово-кредитных.

ПК-25 - способностью интерпретировать результаты финансово-экономических исследований с целью разработки финансовых аспектов перспективных направлений инновационного развития организаций, в том числе финансово-кредитных.

В результате освоения компетенции **ПК - 25** студент должен:

1. Знать:

- перспективные направления инновационного развития организаций, в том числе финансово-кредитных.

2. Уметь:

- выявлять перспективные направления инновационного развития организаций, в том числе финансово-кредитных;
- проводить аналитическое исследование финансовых рисков организаций в том числе финансово-кредитных;

3. Владеть:

- необходимыми навыками, позволяющими определять перспективные направления инновационного развития организаций, в том числе финансово-кредитных в условиях воздействия финансовых рисков.

Содержание дисциплины:

| № п/п | Наименование раздела дисциплины (темы) |
|-------|---|
| 1 | Экономическая сущность и классификация финансовых рисков организаций, в том числе финансово-кредитных |
| 2 | Сущность, задачи и принципы управления финансовыми рисками организаций |
| 3 | Методический инструментарий учёта фактора финансового риска организаций |
| 4 | Риск банкротства как основное проявление финансовых кризисов организаций, в том числе финансово-кредитных |
| 5 | Внутренние механизмы нейтрализации финансовых рисков организаций, в том числе финансово-кредитных |
| 6 | Формы и виды страхования финансовых рисков |

Форма контроля - зачёт