

**Аннотация к рабочей программе дисциплины
«АНАЛИЗ И УПРАВЛЕНИЕ ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКИМИ И
ФИНАНСОВЫМИ РИСКАМ»**

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Бухгалтерский учет, анализ и аудит на предприятиях ТЭК

Квалификация выпускника: бакалавр

Цель освоения дисциплины: изучение предмета, объектов, цели и практических навыков в области организации и управления рисками в деятельности хозяйствующих субъектов, разработки экономически эффективных финансовых и инвестиционных решений.

Объем дисциплины: 3 зачетных единиц, всего 108 часов

Семестр: 5

Краткое содержание основных разделов дисциплины:

№ п/п раздела	Основные разделы дисциплины	Краткое содержание разделов дисциплины
1	Концепция риска и методы его оценки.	Понятие неопределенности и риска. Классификация рисков и их видовая специфика. Вероятность объективная и субъективная. Оценка риска (ожидаемое значение, отклонение, дисперсия, среднее квадратичное отклонение, размах вариации, коэффициент вариации). Отношение к риску. Границы приемлемости риска. Определение степени рисков. Зонирование областей потерь по степени риска. Критерии потерь основных зон риска. Систематический и несистематический риск. Эффект диверсификации. Измерение систематического риска, бета коэффициент. Бета и премия риска. Индекс Трейнора. Линия состояния фондового рынка. Модель ценообразования основных активов (САРМ). Премия риска индивидуального актива. Экспертный метод для оценки вероятности проявления рисков.
2	Методы идентификации, измерения и картографирования рисков	Выявление, актуализация, систематизация и анализ рисков. Методы опросных листов, потоковых диаграмм, инспекций, анализ отчетности и документации, организационной и функциональной структуры предприятия, система «волонтеров». Идентификация источников рисков, оценка и выявление приоритетов риск-факторов при различных процессах управления. Состав и последовательность работ по идентификации и ранжированию рисков. Методы диагностики рисков. Источники сбора информации для идентификации рисков. Графическое представление рисков Картографирование рисков. Построение карты рисков и рискография. Табличное представление информации в разных стандартах по риск-менеджменту
3	Риск-менеджмент - система управления риском	Сущность и содержание риск-менеджмента. Разработка программы действий по снижению риска: последовательность стадий. Особенности принятия решений в области риск-менеджмента. Эвристические правила риск-менеджмента и их действие. Коэффициент риска. Организационные структуры службы риск-менеджмента. Процессный подход к риск-менеджменту в

		организации. Внешний и внутренний мониторинг рисков. Планирование в системе риск-менеджмента.
4	Стратегия риск-менеджмента	Понятие стратегии риск-менеджмента. Основные правила стратегии риск - менеджмента и их действие. Принципы управления риском. Приемы управления риском. Средства разрешения риска (избежание, удержание, передача, снижение степени риска). Способы снижения риска. Диверсификация. Поиск информации. Ассиметрия информации. Оценка эффективности приобретаемой информации. Лимитирование. Объединение риска. Самострахование. Страхование.
5	Методы управления финансовыми рисками	Особенности рынка срочных контрактов и его виды. Фьючерсные контракты. Специфика фьючерсных сделок. Форвардные контракты, их специфика. Форвардный курс. Особенности риска форвардных сделок.

Форма промежуточной аттестации: экзамен