**АННОТАЦИЯ**

**Рабочей программы дисциплины**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Дисциплина** | **Управление финансовыми рисками и инструменты хеджирования** | |
| **Направление подготовки** | 38.04.01 | Экономика |
| **Программа магистратуры** | Финансовый мониторинг и управление рисками | |
| **Объем дисциплины** | 8 з.е. | |
| **Формы промежуточной аттестации** | Зачет  Экзамен  Курсовая работа | |
| **Кафедра** | Финансового менеджмента | |
| **Краткое содержание дисциплины** | | |
| Тема 1. Общие понятия управляемой системы, понятия неопределенности и риска, стандарты управления рисками. Классификация рисков | | |
| Тема 2. Процесс риск-менеджмента | | |
| Тема 3. Идентификация и оценка финансовых рисков | | |
| Тема 4. Методы управления финансовыми рисками | | |
| Тема 5. Инвестиционные риски и методы их минимизации (проектный анализ) | | |
| Тема 6. Инструменты риск-менеджмента на финансовых рынках | | |
| **Список литературы** | | |
| **Основная литература (только из ЭБС)**  1. Домащенко, Д. В. Современные подходы к корпоративному риск-менеджменту: методы и инструменты [Электронный ресурс] : производственно-практическое издание / Д. В. Домащенко, Ю. Ю. Финогенова. - Москва : Магистр: ИНФРА-М, 2019. - 304 с. <http://znanium.com/go.php?id=1006768>  **Дополнительная литература)**  1. Домащенко, Д. В. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности [Электронный ресурс] : [учебное пособие] / Д. В. Домащенко, Ю. Ю. Финогенова. - Москва : Магистр: ИНФРА-М, 2015. - 238 с. <http://znanium.com/go.php?id=502885> | | |
| **Перечень информационных технологий, включая перечень лицензионного программного обеспечения и информационных справочных систем, онлайн курсов, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине** | | |
| **Перечень лицензионное программное обеспечение:**  - Программы для ЭВМ «Лицензия на право установки и использования операционной системы общего назначения Astra Linux Common Edition ТУ 5011-001-88328866-2008 версии 2.12. Контракт на выполнение работ для нужд УРГЭУ № 35-У/2018 от «13» июня 2018 г.  - Программы для ЭВМ «Мой Офис Стандартный. Лицензия Корпоративная на пользователя для образовательных организаций, без ограничения срока действия. Контракт на выполнение работ для нужд УРГЭУ № 35-У/2018 от «13» июня 2018 г.  **Перечень информационных справочных систем, ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:**  Общего доступа  - Справочная правовая система ГАРАНТ  - Справочная правовая система Консультант плюс | | |
| **Перечень онлайн курсов** | | |
| В данной дисциплине не реализуются | | |
| **Перечень профессиональных стандартов** | | |
| 08.018 Профессиональный стандарт «Специалист по управлению рисками», утвержденный приказом Министерства труда и социальной защиты Российской Федерации от 07 августа 2018 г. № 564н | | |

Аннотацию подготовил(а) \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ / Филиппов С.Д.

Заведующий каф. ­­­­­­­­­­­­­­­­­­ / Закирова Э.Р.

**Перечень тем курсовых работ**

|  |  |
| --- | --- |
| **Дисциплина** | **Управление финансовыми рисками и инструменты хеджирования** |
| **Направление подготовки** | 38.04.01 Экономика |
| **Направленность (профиль)** | Финансовый мониторинг и управление рисками |
| **Кафедра** | Финансового менеджмента |
| **Темы курсовых работ** | |
| 1. Методы оценки и анализа рисков финансирования инвестиционного проекта. | |
| 2. Риски ликвидности. Анализ денежных потоков организации как метод управления рисками ликвидности. Пути повышения ликвидности и платежеспособности организации | |
| 3. Кредитные риски. Роль доллара в современных международных валютных и кредитных отношениях. | |
| 4. Валютные риски. Мировой валютный рынок: современное состояние и перспективы развития. Мировая долларизация и ее место в глобализации | |
| 5. Процентные риски. Процентные риски в системе банковских рисков. | |
| 6. Операционные риски: идентификация и оценка. Выбор критерия управления операционными рисками. | |
| 7. Диагностика финансового кризиса предприятия. Анализ рисков при угрозе банкротства. | |
| 8. Система риск-анализа финансовой деятельности предприятия | |
| 9. Система риск-планирования финансовой деятельности предприятия | |
| 10. Система риск-контроллинга финансовой деятельности предприятия | |
| 11. Управление риском снижения финансовой устойчивости предприятия | |
| 12. Управление риском неплатежеспособности предприятия | |
| 13. Управление проектными рисками предприятия | |
| 14. Инвестиционные риски. Оценка и управление рисками инвестиционного проекта | |
| 15. Модели формирования оптимального портфеля ценных бумаг | |
| 16. Рыночные риски. Государственное хэджирование | |
| 17. Страхование финансовых рисков предприятия | |
| 18. Рыночные риски и их хэджирование | |
| 19. Хеджирование на рынке фьючерсов и опционов | |
| 20. Методы управления финансовыми рисками.. Выбор механизмов нейтрализации финансовых рисков. | |
| 21. Хеджирование финансовых рисков предприятия с использованием  производных ценных бумаг | |
| 22. Управление риском неплатежеспособности предприятия | |
| 23. Управление риском снижения финансовой устойчивости предприятия | |
| 24. Система риск-планирования финансовой деятельности предприятия | |
| 25. Система информационного обеспечения управления финансовыми  рисками предприятия | |

Аннотацию подготовил \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ / Филиппов С.Д.

Заведующий каф. ­­­­­­­­­­­­­­­­­­ / Закирова Э.Р.