

Документ подписан простой электронной подписью
 Информация о владельце:
 ФИО: Ушвицкий Лев Исакович
 Должность: и.о. директора Института экономики и управления
 Дата подписания: 07.06.2023 12:01:59
 Уникальный программный ключ:
 46f7031a704c958ffdb4e91f91a17726331d25a8

Аннотация к рабочей программе дисциплины (модуля)

Наименование дисциплины (модуля)	Оценка финансовых рисков
Краткое содержание	Экономическая сущность финансовых рисков. Идентификация понятия «финансовый риск». Характеристика финансовых рисков корпораций. Классификационная система финансовых рисков. Классификация видов финансовых рисков в российской литературе. Классификация видов финансовых рисков в зарубежной литературе. Функции финансовых рисков. Функции финансовых рисков корпораций в российской литературе. Функции финансовых рисков корпораций в зарубежной литературе. Система оценки финансовых рисков. Теоретико-методологические аспекты системы оценки финансовых рисков. Построение системы оценки финансовых рисков. Процесс оценки финансовых рисков. Характеристика процесса оценки финансовых рисков. Оценка спектра риска и риск-профиля корпораций. Оценка спектра финансовых рисков. Оценка финансового риск-профиля корпораций. Процессное управление финансовыми рисками. Оценка риска потери финансовой устойчивости корпораций. Сущность риска потери финансовой устойчивости. Методы его оценки. Оценка риска потери ликвидности корпораций. Сущность риска потери ликвидности. Методы его оценки. Оценка рисков потери деловой активности и снижения эффективности деятельности корпораций. Сущность рисков потери деловой активности и снижения деловой активности. Методы их оценки. Реализация экономико-математических методов в процессе оценки ключевых финансовых рисков корпораций. Классификация экономико-математических методов в процессе их оценки. Практическое их применение. Оценка финансовых рисков корпораций по рейтинговым, балльным моделям. Оценка влияния валютного риска на деятельность корпораций. Оценка финансовых рисков корпораций по рейтинговым моделям. Оценка финансовых рисков корпораций по балльным моделям. Влияние валютного риска на деятельность корпораций. Текущий финансовый риск корпораций: регулирование и оценка по эффекту финансового леввериджа. Оценка финансового риска по эффекту финансового леввериджа. Регулирование финансового риска по эффекту финансового леввериджа. Адаптация информационной базы в качестве информационного стандарта и карты финансовых рисков корпораций в системе управления ими. Адаптация информационной базы в качестве информационного стандарта финансовых рисков корпораций. Адаптация информационной базы в качестве карты финансовых рисков корпораций. Процесс принятия финансовых риск-решений: экономико-математический аспект. Характеристика процесса принятия финансовых риск-решений. Идентификация экономико-математического аспекта в процессе принятия финансовых риск-решений. Классический метод управления финансовыми рисками на основе концепции ожидаемых и неожиданных потерь в корпорациях. Классический метод управления финансовыми рисками на основе концепции ожидаемых в корпорациях. Классический метод управления финансовыми рисками на основе концепции неожиданных в корпорациях. Практическая значимость модели оценки стратегического финансового риска корпораций. Сущность стратегического финансового риска корпораций. Модели оценки

	стратегического финансового риска корпораций.
Результаты освоения дисциплины (модуля)	Осуществляя сбор, обработку, мониторинг и интерпретацию информации о факторах внешней и внутренней среды с помощью методов современной науки и информационных технологий, использует их для оценки финансовых рисков; Опираясь на знания теоретико-методического аппарата по оценке финансовых рисков, выполняет совокупность действий по их выявлению и оценке; Применяет практический опыт для воздействия на финансовые риски с помощью теоретических и эконометрических моделей, используя механизмы нейтрализации финансовых рисков и сокращения потерь.
Трудоемкость, з.е.	4
Формы отчетности	Зачет с оценкой
Перечень основной и дополнительной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)	
Основная литература	1. Ковалев В. В. Финансовый менеджмент : теория и практика. М. : Проспект, 2021. 1104 с. – Книга находится в базовой версии ЭБС IPRbooks. (экземпляров неограниченно). 2. Мануйленко В. В. Управление финансовыми рисками : учебник /Мануйленко В. В., Д. А. Рызин, ; под ред. В. В. Мануйленко. — Москва : КноРус, 2023. (экземпляров неограниченно). 3. Шапкин А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций : монография. М. : Дашков и К, 2020. 544 с. – Книга находится в базовой версии ЭБС IPRbooks. (экземпляров неограниченно).
Дополнительная литература	1. Бригхем Ю., Гапенски Л. Финансовый менеджмент. Том 1. М. : Книга по Требованию, 2017. 521 с. – Книга находится в базовой версии ЭБС IPRbooks. (экземпляров неограниченно). 2. Донцова Л. В., Никифорова Н. А. Анализ финансовой отчетности : практикум. М. : Издательство «Дело и Сервис», 2018. 160 с. (экземпляров неограниченно). 3. Мануйленко В. В., Рызин Д. А. Регулирование и оценка финансовых рисков российских корпораций : проблемы и перспективы : монография / под науч. ред. В. В. Мануйленко. – М. : Проспект, 2020. – 208 с. – ISBN 978-5-392-31092-0. (экземпляров неограниченно). 4. Савицкая Г. В. Экономический анализ : учеб. М. : Инфра-М, 2019. 587 с. (экземпляров неограниченно). 5. Савицкая Г. В. Анализ и диагностика финансово-хозяйственной деятельности предприятия. 7-е изд., перераб. и доп. М. : Инфра-М, 2017. 608 с. (экземпляров неограниченно). 6. Шапкин А. С., Шапкин В. А. Теория риска и моделирование рисков ситуаций : учебник. 7-е изд. М. : Дашков и К°, 2019. 880 с. (экземпляров неограниченно).