

Аннотация дисциплины «Оценка и анализ рисков»

Дисциплина (модуль)	Оценка и анализ рисков
Содержание	<p>Понятие риска, его основные элементы и черты. Причины возникновения экономического риска. Классификация рисков. Основные принципы и этапы управления риском.</p> <p>Количественная оценка финансового риска. Оценки и измерители риска. Анализ и критерии принятия решений в условиях полной неопределенности: правило Вальда, правило Сэвиджа, правило Гурвица, оптимальность по Парето. Критерии принятия решений в условиях частичной неопределенности. Специальные финансовые критерии риска: кредитный риск, депозитный риск, риск страхования и др.</p> <p>Формирование портфеля ценных бумаг. Диверсификация. Рыночный (систематический) и индивидуальный (несистематический) риск ценных бумаг. Измерение риска портфеля. Доходность портфеля. Выбор оптимального портфеля.</p> <p>Портфель Марковица минимального риска. Модель оценки доходности финансовых активов (САРМ). Эффективность рынка. Собственный риск портфеля. Рыночный риск портфеля. Линия рынка капитала. Линия рынка ценных бумаг. Сведение задачи Марковица о формировании портфеля заданной доходности и минимального риска к задаче нелинейного программирования. Теория арбитражного ценообразования.</p> <p>Инвестиционный горизонт. Поведение инвестора, максимизирующего полезность, при изменении длины инвестиционного горизонта. Анализ многопериодного портфеля. Многопериодное эффективное множество. Критерий допустимых потерь.</p>
Реализуемые компетенции	ОК -3; ОК-5; ОК-7; ОПК -1; ОПК -2; ОПК -3; ОПК- 4; ПК-2; ПК -3; ПК-6; ПК-7; ПК-8; ПК-10; ПК-11
Результаты освоения дисциплины (модуля)	<p>Обучающийся должен:</p> <p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - сущность экономического риска, значение экономического риска в предпринимательской деятельности; - основные научные концепции экономического риска; - сущность понятия риска в целом и экономического риска в частности; - классификацию рисков; - методы оценки и прогнозирования рисков; - понятия системы управления рисками; - принципы построения системы риск-менеджмент; - систему операционных риск-индикаторов предприятия; - мероприятия, направленные на минимизацию рисков предприятия; - способы профилактики экономических рисков. <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - классифицировать экономические риски по факторам и по объектам, понимать необходимость выявления, анализа и управления рисками предприятия, основываясь на передовых достижениях наук экономического блока; - использовать методы минимизации экономических рисков . формы

	<p>внутренних нормативных документов хозяйствующих субъектов в области минимизации рисков ;</p> <ul style="list-style-type: none"> - дать представление о взаимосвязях анализа рисков хозяйствующих субъектов с другими экономическими науками; - пользоваться действующими законодательными и нормативными актами; - самостоятельно применять методы минимизации экономических рисков хозяйствующих субъектов с целью обеспечения экономической безопасности предприятия. <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - методиками расчета уровня риска; - методикой управления и минимизации экономических рисков. 				
Трудоемкость, з.е.	3/108 з.е.				
Объем занятий, часов		Лекций	Практических (семинарских занятий)	Лабораторных занятий	Самостоятельная работа
	Всего	34	17	-	57
	В том числе в интерактивной форме	7	4	-	-
Формы самостоятельной работы студентов	Самостоятельная подготовка к темам практических занятий, подготовка докладов, рефератов и презентаций к ним, эссе.				
Формы отчетности (в т.ч. по семестрам)	Зачет – 6 семестр				

Зав. кафедрой АиФК

Декан ФИСФиА



Магомедов С.А.



Шахбанова И.К.