АННОТАЦИЯ

дисциплины Б1.В.03 «Риск-менеджмент»

Объем трудоемкости: 3 зачетные единицы (108 ч., из них – 12,3 ч. контактной работы: лекционных 2 ч.., практических 10 ч.., иной контактной работы 0,3 ч.; самостоятельной работы 87 ч.; контроль 8.7ч.).

Цель дисциплины:

Целью дисциплины «Риск-менеджмент» является формирование целостного представления о функционировании экономической системы в условиях неопределенности, о принципах и сущности риск-менеджмента, системе выявления, анализа и оценки существующих финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки схемы управления рисками.

Задачи дисциплины:

- изучение закономерностей, причин возникновения и сущности экономических рисков;
- исследования методов и инструментов идентификации, анализа и контроля существующих финансово-экономических рисков организации;

- изучение методов анализа и оценки финансово-экономических рисков;
- формирование навыков выбора вариантов решений по минимизации рисков в системе риск-менеджмента на основе исследования финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов.

Место дисциплины в структуре ООП ВО

«Риск-менеджмент» относятся к вариативной части Блока 1 учебного плана магистерской программы «Финансовый менеджмент» (квалификация (степень) «магистр»). Дисциплина предназначена для студентов первого года обучения магистерской программы «Финансы и кредит», читается в девятом семестре 5 курса.

В ходе освоения дисциплины «Риск-менеджмент» студент должен опираться на знания и умения, полученные в результате освоения дисциплин «Статистика», «Финансы», в частности на умение проводить статистический анализ данных, использовать различные методы оценки взаимосвязи изучаемых признаков, знание различных терминов и показателей экономики организаций.

В результате изучения дисциплины «Риск-менеджмент» студенты осваивают знания финансовой теории и практики в области управления рисками. Знания, умения и навыки, освоенные студентами в ходе изучения дисциплины, применяются при изучении таких дисциплин, как «Управление финансовой безопасностью и конкурентоспособностью предприятия», «Управление рисками и актуальные расчеты», «Производные финансовые инструменты », при прохождении производственной практики и написании магистерской диссертации.

Требования к уровню освоения дисциплины

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных компетенций

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1.	ПК-4	способность провести анализ и дать оценку существующих	- подходы и методы качественной и количественной оценки рисков	- применять методы анализа и оценки существующих финансово-	- практическими методами качественной и количественной оценки су-

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
		финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	- методы прогнозирования динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровне	экономических рисков	ществующих финансово-экономических рисков на основе прогноза и обоснования динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- и мезоуровнях
2.	ПК - 13	способность руководить финансовыми службами и подразделениями организаций организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных	-общие принципы организации работы отделов риск-менеджмена в рамках финансовой службы организаций организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных	-организовать систему управления финансовыми рисками в рамках финансовой службы организаций организационно-правовых форм, включая финансово-кредитные	- методами управления финансовыми рисками организаций организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных
3.	ПК-23	способность выявлять и проводить исследования финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки схемы управления рисками	- понятия «риск» и «неопределенность»; - классификацию рисков, их место и роль в экономической деятельности; - основные способы минимизации риска; - методы выявления финансово-экономических рисков хозяйствующих субъектов	- различать взгляды ученых различных школ на теоретические аспекты категорий «риск» и «неопределенность»; -идентифицировать различные виды рисков; проводить исследование финансово-экономических рисков хозяйствующих субъектов для разработки схемы управления рисками; - организовать предупредительные мероприятия по предотвращению и (или) минимизации рисков	- методикой выявления различных видов рисков; - основными методами снижения финансово - экономических рисков и управления рисками.

Основные разделы дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в 9 семестре

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	СРС
1	2	3	4	5	6	7
1.	Сущность и функции экономического риска	13	1	–	–	12
2.	Методы идентификации рисков	16	–	2	–	14

3.	Методы анализа и показатели оценки риска	19	1	2	–	16
4.	Методы минимизации риска	18	−	2	–	16
5.	Оценка эффективности системы риск-менеджмента	17	−	2	–	15
6.	Особенности управления отдельными видами риска	16	−	2	–	14
	Итого по дисциплине:		2	10	–	87

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия/семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

Курсовые работы: не предусмотрены

Форма проведения аттестации по дисциплине: зачет

Основная литература:

1. Шапкин, А.С. Теория риска и моделирование рисковых ситуаций: Учебник, 6-е изд./ А.С. Шапкин. −М.: .: Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2017.− 880с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/93446; http://znanium.com/bookread2.php?book=450763.
2. Шапкин, А. С. Теория риска и моделирование рисковых ситуаций [Текст] : учебник для студентов вузов / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 5-е изд. - М. : Дашков и К°, 2012. - 879 с.
3. Гончаренко, Л. П. Риск-менеджмент [Текст] : учебное пособие / Л. П. Гончаренко, С. А. Филин ; Рос. эконом. акад. им. Г. В. Плеханова ; под ред. Е. А. Олейникова. - Изд. 2-е, стер. - М. : КНОРУС, 2007. - 215 с.
4. Мищенко, А. В. Оптимизационные модели управления финансовыми ресурсами предприятия [Текст] : монография / А. В. Мищенко, Е. В. Виноградова. - Москва : РИОР : ИНФРА-М, 2013. - 336

Автор РПД **:** Соколова Н.В., доцент кафедры ЭАСиФ,
к-т экон. наук, доцент