

АННОТАЦИЯ
дисциплины «Методы и инструменты управления рисками»

Объем трудоемкости: 3 зачетные единицы (108 часов, из них – 26,2 час. контактной работы: лекционных - 8 час., практических - 18 час., ИКР – 0,2 час.; 78 час. самостоятельной работы, контроль – 3,8 час.)

Цель освоения дисциплины: формирование и углубление у магистрантов необходимого объема компетенций, в т.ч. знаний, умений и навыков о современных концепциях, инструментах и методах управления рисками.

Задачи дисциплины: получение необходимых знаний и формирование умений и навыков по:

- овладению теоретическими и прикладными основами управления рисками; идентификации рисков,
- минимизации рисков инвестиционных и инновационных проектов,
- применению сценарного и имитационного подходов к моделированию рисков,
- хеджированию финансовых рисков;
- применению методов и инструментов минимизации факторов риска внутренней и внешней среды предприятия;

Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы.

Дисциплина «Методы и инструменты управления рисками» относится вариативной части Блока 1 "Дисциплины (модули)" учебного плана.

Для изучения дисциплины необходимы базовые знания по следующим дисциплинам: финансовый менеджмент в отраслях, современные проблемы финансовой экономики, практикум по финансовым вычислениям, корпоративная финансовая политика, эконометрика, методология управления инвестиционными проектами.

Овладение основами учебной дисциплины «Методы и инструменты управления рисками» является необходимой базой при углубленном изучении дисциплин, прогнозирование конъюнктуры финансовых рынков, финансовое прогнозирование на предприятии, финансовые стратегии поведения экономических агентов на различных рынках, финансовые инструменты корпоративной защиты.

Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся следующих профессиональных компетенций (ПК)

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1.	ПК-3	способностью проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой	методологические основы риск-менеджмента; современные концепции управления рисками; основные ин-	самостоятельно проводить исследования по: выбору концепции управления рисками на предприятии; идентификации рисков; ранжи-	методами и инструментами проведения самостоятельных исследований по: качественному анализу рисков; идентификации рисков внутренней и внешней

№ п.п.	Индекс компе- тенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающи- еся должны		
			знать	уметь	владеть
			струменты и методы управ- ления рисками; инструменты качественного анализа рисков для проведения самостоятель- ных исследо- ваний	рованию рисков; визуализации факторов риска с помощью гра- фических мето- дов	среды предприятия; оценке факторов риска по уровню возможного ущер- ба и вероятности возникновения факторов риска
2	ПК-4	способностью представлять результаты про- веденного ис- следования научному сооб- ществу в виде статьи или до- клада	классифика- цию рисков внутренней и внешней среды предприятия (проекта); ме- тоды и инстру- менты количе- ственного ана- лиза рисков. Основные тре- бования к оформлению докладов и научных ста- тей.	представлять результаты про- веденного ис- следования в ви- де статьи или доклада по: ко- личественному анализу рисков; применению сценарного под- ход в управле- нии рисками; идентификации допустимых, критических и катастрофиче- ских рисков проектов. Раз- рабатывать ме- роприятия по управлению рисками. Интер- претировать ре- зультаты коли- чественного анализа рисков	методами анализа чувствительности- инвестиционного проекта к факторам риска; методами хеджирования фи- нансовых рисков; современными эко- номико- математическими методами и ин- струментами по моделированию влияния факторов риска на деятель- ность предприятия или отдельного проекта. Умения- ми и навыками по представлению ре- зультатов исследо- вания теоретиче- ских и практиче- ских аспектов управления риска- ми в виде докладов и научных статей

Основные разделы дисциплины:Разделы дисциплины, изучаемые на 6 курсе

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	СРС
1	2	3	4	5	6	7
1.	Концепции и модели риск-менеджмента	11	1	2		8
2.	Факторы риска внутренней и внешней среды предприятия (проекта)	18	2	2		14
3.	Методы и инструменты идентификации рисков	17	1	2		14
4.	Инструменты качественного анализа рисков	19	1	4		14
5.	Методы количественного анализа в риск-менеджменте	20	2	4		14
6.	Методы и инструменты управления рисками	19	1	4		14
	<i>Итого по дисциплине:</i>	104	8	18		78

Курсовые работы: *не предусмотрены***Форма проведения аттестации по дисциплине:** *зачет***Основная литература:**

1. Управление рисками [Электронный ресурс] : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. - М. : Юрайт, 2018. - 414 с. - <https://biblio-online.ru/book/E098C311-CAA9-4FD5-AC72-5F801419DD64>
2. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов / В. Е. Шкурко ; А. В. Гребенкина. 2-е изд. М. : Юрайт, 2018. 182 с. <https://biblio-online.ru/book/98B10AB3-0155-4551-8DA2-1E0AA6E566AC/upravlenie-riskami-proekta>
3. Домашенко Д. В. Управление рисками в условиях финансовой нестабильности / Домашенко Д. В., Финогенова Ю. Ю. - М.: Магистр, ИНФРА-М Издательский Дом, 2015. - 240 с. URL <http://znanium.com/bookread2.php?book=502885#>

Автор РПД: Ю.Н. Александрин, канд. экон. наук, доцент кафедры МЭиМ