

**АННОТАЦИЯ**  
дисциплины  
**Б1.В.ДВ.06.02 ФИНАНСОВЫЕ РИСКИ**  
Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Общее количество часов – 108

Количество зачетных единиц – 3

**Целью освоения дисциплины «Финансовые риски»** является изучение теоретических и методических основ управления рисками и эффективностью инвестиционных проектов в целях выработки современных компетенций в области анализа финансовой ситуации в сфере реальных инвестиций и принятия решений по финансовым вопросам инвестиционного характера.

**Задачи дисциплины:**

- познакомить с результатами новейших исследований в области реальных инвестиций и риск-менеджмента;
- обучить теоретическим основам проектного риск-менеджмента;
- изучить действующую законодательную и нормативную базу, регулируемую инвестиционные процессы в РФ;
- обучить поиску, анализу и оценке финансовой и экономической информации для проведения финансовых расчетов и обоснования принимаемых управленческих решений в процессе реализации инвестиционных проектов;
- изучить подходы к оценке финансовой и экономической эффективности предложенных проектов, анализ финансово-экономических результатов их реализации.

**Место дисциплины в структуре образовательной программы.**

Дисциплина **Б1.В.ДВ.06.02 «Финансовые риски»** относится к вариативной части Блока 1 «Дисциплины по выбору (модули)» учебного плана.

**Результаты обучения (знания, умения, опыт, компетенции).**

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций (согласно ФГОС):

| №<br>п.п. | Индекс<br>компет<br>енции | Содержание<br>компетенции                                 | В результате изучения учебной дисциплины<br>обучающиеся должны |                                                           |                                            |
|-----------|---------------------------|-----------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------|--------------------------------------------|
|           |                           |                                                           | знать                                                          | уметь                                                     | владеть                                    |
|           | <b>ПК- 5</b>              | способностью анализировать и интерпретировать финансовую, | методики расчета финансовых и социально-                       | выбирать инструментальные средства для обработки данных в | навыками выбора и применения инструменталь |

|  |               |                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|---------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |               | бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений                                                      | экономическим показателям                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | соответствии с поставленной задачей                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | ных средств для обработки данных                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|  | <b>ПК- 11</b> | способность критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать, и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий. | <ul style="list-style-type: none"> <li>— сущность категорий, определяющих содержание отдельных ее разделов и тем;</li> <li>— принципы выявления и оценки проектных рисков;</li> <li>— основные методы и приемы управления проектными рисками;</li> <li>— основы осуществления финансовых расчетов,</li> <li>— методы оценки финансовой и экономической эффективности и предложенных проектов.</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>— производить расчеты основных финансовых и экономических показателей оценки эффективности инвестиционных проектов;</li> <li>— проводить оценку уровня риска с использованием различных методов;</li> <li>— обосновывать решения в сфере финансового управления проектом и выбора источников финансирования проекта с учетом риска;</li> <li>— применять методы управления рисками проектов;</li> <li>— выделять факторы риска, влияющие на эффективность инвестиционного проекта;</li> <li>— представлять</li> </ul> | <ul style="list-style-type: none"> <li>— понятийно-терминологическим аппаратом, характеризующим инвестиции и проектный риск-менеджмент;</li> <li>— навыкам и сбору и анализа практического материала, касающегося организации управления проектными рисками и финансового управления реализацией проектов;</li> <li>— методам и финансовым вычислениям для решения практических задач, анализа эффективности проекта,</li> </ul> |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                         |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>статистическую информацию в виде таблиц и графиков;<br/> — рассчитывать абсолютные и относительные величины;<br/> — использовать современный математический и статистический аппарат.</p> | <p>оценивания рисков;<br/> — методам и инвестиционно го анализа; методами и приемами управления проектными рисками.</p> |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

**Курсовые работы:** не предусмотрены

**Форма контроля:** зачет

### **Основная литература:**

1. Управление банковскими рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по направлениям экономики и управления. Автор: Тепман Л. Н., Эриашвили Н. Д. / Москва: Юнити-Дана, 2015.- 311 с. - URL: [http://biblioclub.ru/index.php?page=book\\_view\\_red&book\\_id=446574](http://biblioclub.ru/index.php?page=book_view_red&book_id=446574)
2. Окулов, В.Л. Финансовые институты и рынки [Электронный ресурс]: учебное пособие / В.Л. Окулов ; Санкт-Петербургский государственный университет, Высшая школа менеджмента. - Санкт-Петербург : Высшая школа менеджмента, 2015. - 316 с. - URL: [http://biblioclub.ru/index.php?page=book\\_view\\_red&book\\_id=458077](http://biblioclub.ru/index.php?page=book_view_red&book_id=458077)
3. Никитина Т. В., Репета-Турсунова А. В. Финансовые рынки и институты 2-е изд., испр. и доп.[Электронный ресурс]: Учебник и практикум для прикладного бакалавриата. – М.: Юрайт, 2018.- 140 с. - URL: <https://biblio-online.ru/viewer/CD40AB49-1A28-4F23-B643-9A704C59C8E9/finansovye-rynki-i-instituty#page/1>

### **Дополнительная литература:**

1. Турманидзе, Т.У. Финансовый менеджмент [Электронный ресурс]: учебник / Т.У. Турманидзе, Н.Д. Эриашвили. - Москва : Юнити-Дана, 2015. - 247 с. - URL: [http://biblioclub.ru/index.php?page=book\\_view\\_red&book\\_id=447718](http://biblioclub.ru/index.php?page=book_view_red&book_id=447718)
2. **Финансовый менеджмент [Электронный ресурс]:** Учебное пособие / Чараева М.В., - 2-е изд. - М.:НИЦ ИНФРА-М, 2016. - 240 с. - URL: <http://znanium.com/bookread2.php?book=503293>
3. Филатова Т.В. **Финансовый менеджмент [Электронный ресурс]:** Учеб. пособие. — М.: ИНФРА-М, 2017. — 236 с. - URL: <http://znanium.com/bookread2.php?book=762998>
4. Шапкин А.С. Экономические и финансовые риски [Текст]: оценка, управление, портфель инвестиций .- 8-е изд. .- М.: Дашков и К, 2012 - 543с.\_

Для освоения дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья имеются издания в электронном виде в электронно-библиотечных системах «Лань» и «Юрайт» и др.

Автор: Новикова Е.Н.