

**АННОТАЦИЯ**  
дисциплины «Методы и инструменты управления рисками»

**Объем трудоемкости:** 3 зачетные единицы (108 часов, из них – 28,2 час. контактной работы: лекционных - 8 час., практических - 20 час., ИКР – 0,2 час.; 79,8 час. самостоятельной работы)

**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; | методами и инструментами проведения самостоятельных исследований по: качественному анализу рисков; идентификации рисков внутренней и внешней |

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

**Основные разделы дисциплины:**

Разделы дисциплины, изучаемые в семестре В

| №  | Наименование разделов (тем)                                    | Количество часов |                   |           |    |                      |
|----|----------------------------------------------------------------|------------------|-------------------|-----------|----|----------------------|
|    |                                                                | Всего            | Аудиторная работа |           |    | Внеаудиторная работа |
|    |                                                                |                  | Л                 | ПЗ        | ЛР |                      |
| 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                      | 19               | 1                 | 4         |    | 14                   |
| 4. | Инструменты качественного анализа рисков                       | 21               | 1                 | 4         |    | 16                   |
| 5. | Методы количественного анализа в риск-менеджменте              | 22               | 2                 | 4         |    | 16                   |
| 6. | Методы и инструменты управления рисками                        | 24,8             | 1                 | 4         |    | 19,8                 |
|    | <i>Итого по дисциплине:</i>                                    | <b>107,8</b>     | <b>8</b>          | <b>20</b> |    | <b>79,8</b>          |

**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