

АННОТАЦИЯ

дисциплины «Управление рисками»

Объем трудоемкости: 3 зачетные единицы (108 часов, из них – 26,2 час. контактной работы: лекционных занятий - 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 «Управление рисками» относится вариативной части Блока 1 "Дисциплины (модули)" учебного плана.

Для изучения дисциплины необходимы базовые знания по следующим дисциплинам: современные проблемы финансовой экономики, практикум по финансовым вычислениям, финансовый менеджмент в отраслях, эконометрика (продвинутый уровень), корпоративное финансовое управление, управление инвестиционными проектами, финансовое прогнозирование на предприятии.

Овладение основами учебной дисциплины «Управление рисками» является необходимой базой при углубленном изучении дисциплин: оценка и управление стоимостью компании, финансовые стратегии поведения экономических агентов на различных рынках, финансовое планирование и бюджетирование на предприятии, 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	самостоятельно проводить исследования по: выбору концепции управления рисками на предприятии;	методами и инструментами проведения самостоятельных исследований по: качественному анализу рисков; идентифи-

№ п.п.	Индекс компе- тенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающи- еся должны		
			знать	уметь	владеть
			рисками; ос- новные ин- струменты и методы управ- ления рисками; инструменты качественного анализа рисков для проведения самостоятель- ных исследо- ваний	идентификации рисков; ранжи- рованию рисков; визуализации факторов риска с помощью гра- фических мето- дов	кации рисков внут- ренней и внешней 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	
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