

## АННОТАЦИЯ

дисциплины Б1.В.ДВ.02.02 «Управление рисками инвестиционных проектов»

**Объем трудоемкости:** 2 зачетные единицы (72 часа, из них контактной работы – 24,2 ч., в том числе 24 ч. аудиторной работы: лекционных 4 ч., практических 20 ч.; ИКР – 0,2 ч.; 44 часов самостоятельной работы, контроль – 3,8 ч.)

### **Цель дисциплины:**

Цель дисциплины - сформировать системное представление о сущности и содержании процесса управления инвестиционными проектами в условиях риска и неопределенности, включая анализ и оценку существующих финансово-экономических рисков, инструментов финансового рынка и обоснование прогноза динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро-, мезоуровне направленное на формирование компетенций в области инвестиционной деятельности.

### **Задачи дисциплины:**

1. познакомить с результатами современных разработок в области проектно-экономической деятельности, подготовки финансового раздела бизнес-плана инвестиционных проектов и риск-менеджмента инвестиционного проекта;

2. изучить научные подходы к оценке финансовой и экономической эффективности инвестиционных проектов, проведению финансово-экономических расчетов и результатов их реализации на основе различных источников информации с учетом современных инструментов финансового рынка;

3. сформировать знания в области методики анализа и методов оценки экономической информации для проведения финансовых расчетов и обоснования принимаемых управленческих решений в области управления финансово-экономическими рисками инвестиционных проектов с учетом динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро-, мезоуровне;

4. выработать навыки анализа финансовой ситуации в сфере реальных инвестиций и обоснования принимаемых управленческих решений по финансовым вопросам инвестиционного характера;

5. изучить основные методы и механизмы управления финансово-экономическими проектными рисками инвестиционных проектов;

6. сформировать компетенции по управлению инвестиционным проектом и сопутствующих его реализации финансово-экономических рисков.

### **Место дисциплины в структуре ООП ВО**

Дисциплина «Управление рисками инвестиционных проектов» относится к дисциплине по выбору в вариативной части Блока 1 учебного плана по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» (квалификация (степень) «магистр»). Дисциплина предназначена для студентов второго года обучения магистерской программы «Финансы и кредит», предусматривается к изучению в семестре В 6 курса.

Дисциплина опирается на знания и навыки, приобретенные в результате изучения дисциплин «Регулирование финансовых рынков», «Фундаментальный анализ фондовых рынков», «Экономика финансового посредничества» и др., изучаемых в рамках магистерской подготовки.

Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, применяются в процессе изучения дисциплин «Финансовые инновации и финансовый инжиниринг», «Международные финансовые рынки», 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 компет	Содержание компетенции	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны
--------	---------------	------------------------	---

	енции	(или её части)	<b>знать</b>	<b>уметь</b>	<b>владеть</b>
1.	ПК-2	способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов	- источники информации для проведения финансово-экономических расчетов; - методы анализа информации для оценки риска и финансовой эффективности инвестиционного проекта.	- анализировать эффективность и риск инвестиционного проекта на основе различных источников информации; - применять методику расчета показателей для проведения финансово-экономических расчетов по оценке эффективности инвестиционных проектов в коммерческих и некоммерческих организациях различных организационно-правовых форм, включая финансово-кредитных, органов государственной власти и местного самоуправления	– навыками сбора и анализа информации для проведения финансово-экономических расчетов по оценке эффективности и риска инвестиционного проекта. -навыком применения методов анализа финансовой отчетности предприятия при оценке финансовой реализуемости проекта.
2.	ПК-4	способность провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро-, мезоуровне	– принципы выявления и идентификации финансовых рисков инвестиционных проектов; - основные методы оценки и прогнозирования финансовых рисков инвестиционных проектов и динамики основных финансово-экономических показателей на	– проводить оценку и анализ финансовых рисков инвестиционных проектов; – применять методы прогнозирования динамики основных финансово-экономических показателей, в частности уровня риска и ожидаемой доходности инвестиционного	– методами финансовых вычислений для решения практических задач, анализа эффективности проекта с учетом риска; - методами анализа и оценки финансово-экономических рисков проектов с учетом микро- и макроэкономической ситуации.

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
			микро-, макро- и мезоуровне.	проекта.	
3.	ПК-23	способность выявлять и проводить исследования финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки схемы управления рисками	– основные методы выявления и исследования финансово-экономических рисков инвестиционного проекта; – современные инструменты воздействия на финансово-экономические проектные риски; – современные концепции риск-менеджмента инвестиционного проекта.	– проводить исследование финансово-экономических рисков проектов с использованием различных методов; – разрабатывать алгоритм воздействия на финансово-экономические риски инвестиционного проекта для разработки механизма управления рисками.	– понятийно-терминологическим аппаратом, характеризующим инвестиции и риск-менеджмент проекта; -методами финансовых вычислений для решения практических задач в области анализа и управления рисками.

### Основные разделы дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.  
Разделы дисциплины, изучаемые в В семестре

№ раздела	Наименование тем	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1	2	3	4	5	6	7
1.	Инвестиционный проект: сущность, разработка и управление, оценка проектов, финансирование посредством инструментов финансового рынка	8,5	0,5	4	-	4
2.	Сущность и функции инвестиционных рисков. Система рисков инвестиционного проекта.	6,5	0,5	2	-	4
3.	Риск-менеджмент проекта: принципы и подходы к управлению рисками проектов. Алгоритм управления рисками инвестиционного проекта.	7	1	2	-	4
4.	Анализ финансово-экономических рисков проекта.	11	1	2	-	8

5.	Качественные методы оценки финансово-экономических рисков инвестиционных проектов.	10	-	2	-	8
6.	Количественные методы оценки финансово-экономических рисков инвестиционных проектов.	17	1	6	-	10
7.	Новые подходы в риск-менеджменте	8	-	2	-	6
	<i>Итого по дисциплине:</i>		4	20	-	44

**Курсовые работы:** не предусмотрены

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** зачет

**Основная литература:**

1. Мамий Е.А., Пышнограй А.П., Новиков А.В. Инвестиции: учебник / Е.А. Мамий, А.П. Пышнограй, А.В. Новиков, под ред. Е.А. Мамий. – Краснодар: Просвещение-Юг, 2016.-517 с.

2. Риск-менеджмент инвестиционного проекта [Текст] : учебник для студентов вузов / под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина. - М. : [ЮНИТИ-ДАНА] , 2009. - 544 с.

3. Управление инвестиционными проектами в условиях риска и неопределенности : учебное пособие для бакалавриата и магистратуры / Л. Г. Матвеева, А. Ю. Никитаева, О. А. Чернова, Е. Ф. Щипанов. — М. : Издательство Юрайт, 2018. — 298 с. — (Серия : Университеты России). — ISBN 978-5-534-04586-4. — Режим доступа : [www.biblio-online.ru/book/9D230457-295D-459F-A3A9-9F1291E24A0C](http://www.biblio-online.ru/book/9D230457-295D-459F-A3A9-9F1291E24A0C).

4.Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов / В. Е. Шкурко ; под науч. ред. А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — М. : Издательство Юрайт, 2018. — 182 с. — (Серия : Университеты России). — ISBN 978-5-534-05843-7. — Режим доступа : [www.biblio-online.ru/book/98B10AB3-0155-4551-8DA2-1E0AA6E566AC](http://www.biblio-online.ru/book/98B10AB3-0155-4551-8DA2-1E0AA6E566AC)

Автор РПД

Мамий Е.А.