

**АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ**  
**Б1.В.04 Анализ и оценка рисков**  
Направление подготовки 38.03.01 Экономика

**Объем трудоемкости:** 2 зачетные единицы

**Цель освоения дисциплины** «Анализ и оценка рисков» – является обучение студентов теоретическим основам и практическим приемам компьютерного моделирования рисков предприятия в целях принятия обоснованных управленческих решений.

**Задачи дисциплины:**

1. Приобретение базовых знаний и умений в области управления рисками.
2. Изучение инструментов и методов планирования управления рисками.
3. Формирование знаний и базовых навыков в области риск-менеджмента.
4. Изучение инструментов и методов идентификации рисков.
5. Изучение инструментов и методов планирования реагирования на риски.
6. Разработка мероприятий по предотвращению рисков или ответа на них.
7. Изучение инструментов и методов контроля рисков.
8. Систематизация знаний и умений, необходимых в процессе управления рисками.

**Место дисциплины в структуре образовательной программы**

Дисциплина «Анализ и оценка рисков» относится к Части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана. В соответствии с рабочим учебным планом дисциплина изучается на 2 курсе по очной и очно-заочной форме обучения.

Для изучения данной дисциплины необходимы следующие знания, умения и навыки, формируемые предшествующими дисциплинами.

**Требования к уровню освоения дисциплины**

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Код и наименование индикатора* достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
<b>ПК 3 Способен разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками</b>	
<b>ИПК 3.2</b> Разрабатывает и использует методы и техники анализа рисков с учётом оценки влияния различных факторов	<b>Знает</b> основные положения, инструменты, методы анализа и оценки риска. <b>Умеет</b> организовать и провести сбор информации, необходимой для выявления основных факторов риска и оценки его уровня, систематизировать массивы полученных данных. <b>Осуществляет</b> анализ и количественную оценку рисков, в том числе при реализации инвестиционных проектов

Код и наименование индикатора* достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
<b>ПК 4 Способен осуществлять подготовку инвестиционного проекта</b>	
<b>ПК 4.2</b> Разрабатывает и использует методы и техники анализа рисков с учётом оценки влияния различных факторов	<p>Знает факторы рисков, принципы, особенности и техники их оценки</p> <p><b>Умеет</b> экономически обоснованно использовать методы снижения рисков для управления организациями и инвестиционными проектами</p> <p>Планирует распределения рисков реализации инвестиционного проекта между всеми участниками проекта и оказывает методическую помощь сотрудникам в выявлении и оценке рисков</p>

\*Вид индекса индикатора соответствует учебному плану.

### Содержание дисциплины

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в 4 семестре очная форма обучения

№	Наименование разделов	Количество часов			
		Всего	Аудиторная работа		Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	
1	Анализ чувствительности проектов долгосрочных инвестиций	7,8	2	2	3,8
2	Измерение риска долгосрочных инвестиционных проектов	8	2	2	4
3	Основы теории рыночных опционов	14	4	4	6
4	Использование эквивалентных портфелей для оценки рисковых инвестиций и управления рисками в реальном секторе экономики	14	4	4	6
5	Многопериодные биномиальные модели оценки рисковых инвестиций и стоимости бизнеса в реальном секторе экономики	14	4	4	6
6	Непрерывные модели обоснования многопериодных инвестиций и оценки стоимости бизнеса.	10	2	2	6
	<i>ИТОГО по разделам дисциплины</i>	<b>67,8</b>	<b>18</b>	<b>18</b>	<b>31,8</b>
	Контроль самостоятельной работы (КСР)	<b>4</b>			
	Промежуточная аттестация (ИКР)	<b>0,2</b>			
	Подготовка к зачету	-			
	Общая трудоемкость по дисциплине	<b>72</b>			

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в 4 семестре очно-заочная форма обучения

№	Наименование разделов	Количество часов			
		Всего	Аудиторная работа		Внеаудиторная работа СР
			Л	ПЗ	
1	Анализ чувствительности проектов долгосрочных инвестиций	10	2	2	6
2	Измерение риска долгосрочных инвестиционных проектов	10	2	2	6
3	Основы теории рыночных опционов	12	2	2	8
4	Использование эквивалентных портфелей для оценки рискованных инвестиций и управления рисками в реальном секторе экономики	12	2	2	8
5	Многопериодные биномиальные модели оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса в реальном секторе экономики	12	2	2	8
6	Непрерывные модели обоснования многопериодных инвестиций и оценки стоимости бизнеса.	11,8	2	2	7,8
	<i>ИТОГО по разделам дисциплины</i>	<b>67,8</b>	<b>12</b>	<b>12</b>	<b>43,8</b>
	Контроль самостоятельной работы (КСР)	<b>4</b>			
	Промежуточная аттестация (ИКР)	<b>0,2</b>			
	Подготовка к зачету	-			
	Общая трудоемкость по дисциплине	<b>72</b>			

**Курсовые работы:** не предусмотрены

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** зачет

Автор: Айвазов А.Л.