

1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель дисциплины

Целью дисциплины «Современная практика риск-менеджмента» является формирование у магистрантов современных компетенций в области управления финансово-экономическими рисками хозяйствующих субъектов в условиях цифровой экономики, включая выявление, оценку и разработку программы минимизации существующих финансово-экономических рисков.

1.2 Задачи дисциплины

- изучить современные теории в области управления рисками инвестиционных проектов;
- выработать навыки идентификации существующих финансово-экономических рисков на различных этапах реализации инвестиционных проектов;
- сформировать знания и умения в области анализа и методов воздействия на рисковую нагрузку инвестиционных проектов;
- освоить навыки выбора варианта минимизации рисков в системе риск-менеджмента на основе исследования финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов;
- сформировать компетенции в области организации и руководства отдела риск-менеджмента как подразделения финансовой службы организации.

1.3 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина Б1.В.13 «Современная практика риск-менеджмента» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 "Дисциплины (модули)" учебного плана. В соответствии с рабочим учебным планом дисциплина изучается на 2 курсе. Вид промежуточной аттестации: зачет.

Дисциплина «Современная практика риск-менеджмента» находится в логической и содержательно-методической взаимосвязи с другими частями ОПОП и базируется на знаниях, полученных обучающимися в таких дисциплинах, как: «Финансовые рынки и институты», «Методология и организация экономических исследований», «Системы искусственного интеллекта», «Нормативно-правовое регулирование в финансовой сфере».

Полученные в процессе обучения знания могут быть использованы при изучении таких дисциплин, как: «Управление портфельным инвестированием», «Финансовое консультирование», «Финансовые технологии».

1.4 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

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

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
ИПК-2.2 Демонстрирует способность разрабатывать финансовый план и целевой инвестиционный портфель для клиента	Знает понятийный аппарат современного риск-менеджмента; Знает современные методы управления рисками инвестиционных проектов
	Умеет определять инвестиционные предпочтения клиентов; Умеет формировать инвестиционный профиль потенциальных клиентов
	Определение степени склонности к риску клиентов;

	Составление рекомендаций по управлению инвестиционными рисками на основе стресс-тестов
ИПК- 6.1 Демонстрирует способность управлять эффективностью инвестиционного проекта	Знает понятийный аппарат современного риск-менеджмента; Знает современные методы управления рисками инвестиционных проектов
	Умеет определять рисковую нагрузку инвестиционных проектов; Умеет воздействовать на параметры риска и доходности инвестиционных проектов
	Выявление и документальная фиксация отдельных категорий рисков; Разработка мероприятий по воздействию на рисковую нагрузку инвестиционных проектов
ИПК-6.3 Применяет инструментарий управления рисками инвестиционного проекта	Знает системные подходы к управлению рисковкой нагрузкой инвестиционных проектов; Знает принципы и методы воздействия на риски инвестиционных проектов; Знает особенности воздействия рисковкой нагрузки в отдельных отраслях экономики
	Умеет квантифицировать рисковую нагрузку инвестиционных проектов; Умеет применять матричные методы анализа рисков
	Выявление и документальная фиксация отдельных категорий рисков; Разработка мероприятий по воздействию на рисковую нагрузку инвестиционных проектов
ИПК-6.4 Демонстрирует способность управлять сроками и контролировать реализацию проекта	Знает понятийный аппарат современного риск-менеджмента; Знает современные методы управления рисками инвестиционных проектов
	Умеет определять рисковую нагрузку инвестиционных проектов; Умеет воздействовать на параметры риска и доходности инвестиционных проектов
	Выявление и документальная фиксация отдельных категорий рисков; Разработка мероприятий по воздействию на рисковую нагрузку инвестиционных проектов

Содержание дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.
Разделы (темы) дисциплины, изучаемые на втором курсе (заочная форма)

№ разд ела	Наименование тем	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	СРС
1	2	3	4	5	6	7
1.	Сущность и функции экономического риска	18	2	2		14
2.	Методы идентификации рисков в условиях цифровизации	18	2	2		14
3.	Трансформация методов анализа риска в цифровой экономике	18		2		16
4.	Методы минимизации риска	18		2		16
5.	Оценка эффективности системы риск-менеджмента	18		2		16
6.	Организация риск-менеджмента на предприятии	18		2		16
	<i>Итого по дисциплине:</i>		4	12		92

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия / семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

Курсовые работы: не предусмотрены

Форма проведения аттестации по дисциплине: зачет

Автор: к.э.н., доцент кафедры Мировой экономики и менеджмента Руденко О.Н.