

## Аннотации к рабочим программам дисциплин

### Аннотация к рабочей программы дисциплины «Б1.В.16 Анализ и управление финансовыми рисками» (код и наименование дисциплины)

**Объем трудоемкости:** 3 зачетных единиц

**Цели и задачи изучения дисциплины (модуля).**

**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 финансовых рисков инвестиционных и инновационных проектов,
- применению сценарного и имитационного подходов к моделированию рисков,
- хеджированию финансовых рисков;
- применению методов и инструментов минимизации финансовых рисков внутренней и внешней среды предприятия (проекта)

#### Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина «Анализ и управление финансовыми рисками» 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 форме обучения. Вид промежуточной аттестации: экзамен.

Для изучения дисциплины необходимы базовые знания по таким дисциплинам, как: корпоративный финансовый менеджмент, финансовые рынки и институты, актуальные проблемы финансовой экономики, практикум по финансовым вычислениям, управление инвестиционными проектами.

#### Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), 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 (знает, умеет, навык (владеет, может осуществить трудовое действие))
ПК-2 Способен анализировать и формировать финансовые планы, оказывать консультации по широкому спектру финансовых услуг	
ИПК - 2.2 Разрабатывает финансовые планы и стратегии инвестирования	Знает методы управления финансовыми рисками
	Знает концепции управления рисками
	Умеет разрабатывать и анализировать финансовые планы с учетом факторов риска
	Умеет прогнозировать факторы финансовых рисков внутренней и внешней среды
	Владеет навыками разработки рекомендаций по управлению инвестиционными рисками
	Владеет инструментами количественного и качественного анализа финансовых рисков
ПК-4 Способен управлять инвестиционным проектом	
	Знает классификацию рисков внутренней среды инвестиционного проекта

Код и наименование индикатора* достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине ( <i>знает, умеет, навык (владеет, может осуществить трудовое действие)</i> )
ИПК- 4.1 Демонстрирует способность управлять эффективностью инвестиционного проекта	Знает классификацию рисков внешней среды инвестиционного проекта
	Умеет проводить идентификацию рисков
	Умеет оценивать уровень рисков инвестиционного проекта
	Владеет методами и инструментами управления рисками инвестиционных проектов
	Владеет инструментами количественного и качественного анализа рисков инвестиционных проектов
ИПК-4.3 Применяет инструментарий управления рисками инвестиционного проекта	Знает классификацию рисков внутренней и внешней среды инвестиционных проектов
	Знает методы и инструменты управления рисками инвестиционного проекта
	Умеет проводить качественный анализ рисков
	Умеет проводить количественный анализ рисков
	Владеет навыками разработки рекомендаций по управлению рисками инвестиционного проекта
	Владеет методикой расчета интегрального показателя инвестиционных рисков
ИПК-4.4 Демонстрирует способность управлять сроками и контролировать реализацию инвестиционного проекта	Знает факторы риска нарушения сроков реализации инвестиционных проектов
	Знает методику имитационного моделирования результатов проекта
	Умеет разрабатывать сценарии реализации инвестиционного проекта
	Умеет проводить анализ чувствительности инвестиционного проекта к факторам риска
	Владеет методикой расчета возможного ущерба проекта от факторов риска
	Владеет навыками разработки рекомендаций по управлению рисками инвестиционных проектов

### Структура и содержание дисциплины

Распределение трудоёмкости дисциплины по видам работ:

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

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа СРС
			Л	ПЗ	ЛР	
1.	Концепции и модели управления финансовыми рисками		2	2		6
2.	Факторы рисков внутренней и внешней среды предприятия (проекта)		2	2		14
3.	Методы и инструменты идентификации рисков		2	2		12
4.	Инструменты качественного анализа финансовых рисков		4	4		13
5.	Методы количественного анализа финансовых рисков в риск-менеджменте		4	2		12
6.	Методы и инструменты управления финансовыми рисками		2	4		18
	<i>ИТОГО по разделам дисциплины</i>	81	16	16		49
	Контроль самостоятельной работы (КСР)					
	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,3				
	Подготовка к текущему контролю	26,7				
	Общая трудоемкость по дисциплине	<b>108</b>				

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

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые на 2 курсе (*заочная форма обучения*)

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа СРС
			Л	ПЗ	ЛР	
1.	Концепции и модели управления финансовыми рисками		-	1		2
2.	Факторы рисков внутренней и внешней среды предприятия (проекта)		1	2		4
3.	Методы и инструменты идентификации рисков		-	2		4
4.	Инструменты качественного анализа финансовых рисков		1	2		9
5.	Методы количественного анализа финансовых рисков в риск-менеджменте		1	2		10
6.	Методы и инструменты управления финансовыми рисками		1	3		12
	<i>ИТОГО по разделам дисциплины</i>	99	4	12		83
	Контроль самостоятельной работы (КСР)					
	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,3				
	Подготовка к текущему контролю	8,7				
	Общая трудоемкость по дисциплине	<b>108</b>				

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

**Курсовая работа:** не предусмотрена

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** экзамен

**Автор:** Александрин Ю.Н., канд. экон. наук, доцент