

## 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
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:** Милета В.И., канд. экон. наук, доцент