

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 (<i>знает, умеет, навык (владеет, может осуществить трудовое действие)</i>)
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 – концепции управления рисками
	Умеет: – разрабатывать и анализировать финансовые планы с учетом факторов риска – прогнозировать факторы финансовых рисков внутренней и внешней среды
	Трудовое действие: – разрабатывает рекомендации по управлению инвестиционными рисками – применяет инструменты количественного и качественного анализа финансовых рисков

Код и наименование индикатора* достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине (<i>знает, умеет, навык (владеет, может осуществить трудовое действие)</i>)
ПК-4 Способен управлять инвестиционным проектом	
ИПК- 4.1 Демонстрирует способность управлять эффективностью инвестиционного проекта	Знает: – классификацию рисков внутренней среды инвестиционного проекта – классификацию рисков внешней среды инвестиционного проекта
	Умеет: – проводить идентификацию рисков – оценивать уровень рисков инвестиционного проекта
	Трудовое действие: – применяет методы и инструменты 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 сред инвестиционных проектов – методы и инструменты управления рисками инвестиционного проекта
	Умеет: – проводить качественный анализ рисков – проводить количественный анализ рисков
	Трудовое действие: – разрабатывает рекомендации 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 – методику имитационного моделирования результатов проекта
	Умеет: – разрабатывать сценарии реализации инвестиционного проекта – проводить анализ чувствительности инвестиционного проекта к факторам риска
	Трудовое действие: – владеет методикой расчета возможного ущерба проекта от факторов риска – разрабатывает рекомендации 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
	ИТОГО по разделам дисциплины	81	16	16		49
	Контроль самостоятельной работы (КСР)					
	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,3				
	Подготовка к текущему контролю	26,7				
	Общая трудоемкость по дисциплине	108				

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
	ИТОГО по разделам дисциплины	99	4	12		83
	Контроль самостоятельной работы (КСР)					
	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,3				
	Подготовка к текущему контролю	8,7				
	Общая трудоемкость по дисциплине	108				

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