

Аннотация к рабочей программе дисциплины
«Б1.В.13 СОВРЕМЕННАЯ ПРАКТИКА РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА»
(код и наименование дисциплины)

Объем трудоемкости: 3 зачетные единицы

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.

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.

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».

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
ПК-2 Способен консультировать клиентов по составлению финансового плана и формированию целевого инвестиционного портфеля	
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;

	<p>Умеет формировать инвестиционный профиль потенциальных клиентов</p> <p>Определение степени склонности к риску клиентов;</p> <p>Составление рекомендаций по управлению инвестиционными рисками на основе стресс-тестов</p>
ПК-6 Способен реализовывать инвестиционный проект	
ИПК- 6.1 Демонстрирует способность управлять эффективностью инвестиционного проекта	<p>Знает понятийный аппарат современного риск-менеджмента;</p> <p>Знает современные методы управления рисками инвестиционных проектов</p>
	<p>Умеет определять рисковую нагрузку инвестиционных проектов;</p> <p>Умеет воздействовать на параметры риска и доходности инвестиционных проектов</p>
	<p>Выявление и документальная фиксация отдельных категорий рисков;</p> <p>Разработка мероприятий по воздействию на рисковую нагрузку инвестиционных проектов</p>
ИПК-6.3 Применяет инструментарий управления рисками инвестиционного проекта	<p>Знает системные подходы к управлению рискованной нагрузкой инвестиционных проектов;</p> <p>Знает принципы и методы воздействия на риски инвестиционных проектов;</p> <p>Знает особенности воздействия рискованной нагрузки в отдельных отраслях экономики</p>
	<p>Умеет квантифицировать рисковую нагрузку инвестиционных проектов;</p> <p>Умеет применять матричные методы анализа рисков</p>
	<p>Выявление и документальная фиксация отдельных категорий рисков;</p> <p>Разработка мероприятий по воздействию на рисковую нагрузку инвестиционных проектов</p>
ИПК-6.4 Демонстрирует способность управлять сроками и контролировать реализацию проекта	<p>Знает понятийный аппарат современного риск-менеджмента;</p> <p>Знает современные методы управления рисками инвестиционных проектов</p>
	<p>Умеет определять рисковую нагрузку инвестиционных проектов;</p> <p>Умеет воздействовать на параметры риска и доходности инвестиционных проектов</p>
	<p>Выявление и документальная фиксация отдельных категорий рисков;</p> <p>Разработка мероприятий по воздействию на рисковую нагрузку инвестиционных проектов</p>

Содержание дисциплины

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 3 зач.ед. (108 часов). Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в семестре «3» (очная форма)

№ раздела	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	3		13
2.	Методы идентификации рисков в условиях цифровизации	18	2	3		13
3.	Трансформация методов анализа риска в цифровой экономике	18	2	3		13
4.	Методы минимизации риска	18		3		15
5.	Оценка эффективности системы риск-менеджмента	17,8		3		14,8
6.	Организация риск-менеджмента на предприятии	18		3		15
	<i>Итого по дисциплине:</i>		6	18		83,8

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

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые на втором курсе (заочная форма)

№ раздела	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 предусмотрена

Форма проведения аттестации по дисциплине: зачет

Автор: к.э.н., доцент кафедры ЭАСиФ В.А. Тюфанов