АННОТАЦИЯ

Дисциплины

Б1.В.8 «МАТЕМАТИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ТЕОРИИ РИСКОВ: ПРОДВИНУТЫЙ УРОВЕНЬ»

Направление подготовки /специальность – 38.03.02 «*Менеджмент*»

Квалификация (степень) выпускника – *магистр*

Профиль – *стратегический менеджмент*

**1. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы**

Дисциплина относится к обязательной части/части, формируемой участниками образовательных отношений блока 1 «Обязательная дисциплина».

1. **Цель и задачи дисциплины**

Целью изучения дисциплины является овладение основами использования производных финансовых инструментов для хеджирования различных бизнес-рисков.

- Для достижения цели дисциплины решаются следующие задачи:

- умение выявлять, анализировать и оценивать риски инвестиционных проектов;

- получение навыков расчета риска инвестиционных проектов;

- получение навыков использования производных финансовых инструментов для хеджирования денежных позиций компании;

- получение навыков использования производных финансовых инструментов для хеджирования валютных международных сделок компании;

- уметь учитывать риски корпоративного кредитования;

- уметь разрабатывать мероприятия по диагностике, предупреждению и нейтрализации последствий рискованных ситуаций в бизнесе.

**3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине**

Изучение дисциплины направлено на формирование следующих компетенций, сформированность которых, оценивается с помощью индикаторов достижения компетенций:

| Индикатор достижения компетенции | Планируемые результаты обучения | Материалы, необходимые для оценки индикатора достижения компетенции |
| --- | --- | --- |
| *Код. Наименование компетенции* | | |
| *Код. Наименование индикатора.*  ПК-1.1.2 Знает предметную область и специфику деятельности организации в объеме, достаточном для решения бизнес-задач.  ПК-4.1.1 Знает инструменты риск-менеджмента  ПК-1.2.5 Умеет анализировать внутренние (внешние) факторы и условия, влияющие на деятельность организации.  ПК-1.2.7 Умеет проводить оценку эффективности и риска решения с точки зрения выбранных критериев;  ПК-1.3.1 Владеет методами выявления, сбора и анализа информации для формирования возможных решений;  ПК-2.3.1 Имеет навыки проведения анализа решений с точки зрения достижения целевых показателей. | *Обучающийся знает:*  *- Финансовую математику в расчетах риска проектов;*   * *Основы теории вероятностей в объеме, необходимом для расчета соответствующих показателей риска;* * *Методологию разработки мероприятий по минимизации рисков;* * *Производные финансовые инструменты.*   *Обучающийся умеет:*   * *Рассчитывать показатели риска инвестиционных проектов;* * *Использовать производные финансовые инструменты для хеджирования денежных позиций компании;* * *Рассчитывать риск и доходность портфеля ценных бумаг.*   *Обучающийся владеет:*   * *Навыками использования производных финансовых инструментом для хеджирования процентных и валютных рисков компании;* * *Навыками расчета риска инвестиционных проектов.*   *Обучающийся имеет:*   * *Навыками использования производных финансовых инструментом для хеджирования процентных и валютных рисков компании;* * *Навыками расчета риска инвестиционных проектов.* | Тесты № 1 – 3  Решение задач в течение всего цикла обучения |

**4. Содержание и структура дисциплины для магистрантов дневной формы обучения**

Наименования разделов дисциплины:

1. Теоретические основы изучения риска как объекта управления;
2. Расчет риска при принятии инвестиционных решений;
3. Управление процентным риском: цели, задачи и инструменты;
4. Управление рисками в банковской сфере;
5. Риск корпоративного кредитования и рейтинг индивидуальных кредитов;
6. Управление рисками в международном бизнесе.
7. **Объем дисциплины и виды учебной работы**

Объем дисциплины – 3 зачетных единиц (108 час.), в том числе:

лекции – 16 час.

Практические занятия – 32 час.

Самостоятельная работа – 56 час.

Форма контроля знаний – 4 час.

**4.1 Содержание и структура дисциплины для магистрантов заочной формы обучения**

Наименования разделов дисциплины:

1. Теоретические основы изучения риска как объекта управления;
2. Расчет риска при принятии инвестиционных решений;
3. Риск корпоративного кредитования и рейтинг индивидуальных кредитов;
4. Управление процентным риском: цели, задачи и инструменты;
5. **Объем дисциплины и виды учебной работы**

Объем дисциплины – 3 зачетных единиц (108 час.), в том числе:

лекции – 4 час.

Практические занятия – 10 час.

Самостоятельная работа – 90 час.

Форма контроля знаний – 4 час.