Приложение 10 ОП ВО

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.1.2 «Управление рисками Riskmanagement»

наименование дисциплин (модуля)

Автор: к.т.н, доцент Солнцев В.И.
Код и наименование направления подготовки, профиля:
38.04.02 «Менеджмент», профиль «Инновационный менеджмент»
Квалификация (степень) выпускника: магистр
Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины: сформировать компетенцию в области управления организациями, подразделениями, группами (командами) сотрудников, проектами и сетями использования современных методов управления корпоративными финансами для решения стратегических задач (ПК-1, ПК-3).

План курса:

Topic 1. Introduction to risk management for investment projects
Course goals and objectives.
Concept of an investment project.
Concept of risk and uncertainty.
Attitude of project participants to risk. Concept of risk minimization and acceptance risk. Decision-making in the presence of risk.

Topic 2. Methodology and stages of risk management with regard to an investment project
Stages and arrangement of risk management with regard to an investment project.
Coordination of interests of project participants. Risk management tools.

Topic 3. Identification and qualitative risk analysis
Information basis of investment project risk analysis.
Approaches to project risks detection.
Systems of project risks classification.
Tools used to detect and perform qualitative analysis of project risks.

Topic 4. Quantitative risk analysis for investment projects
Criteria applied to evaluate the efficiency of investment projects.
Approaches to quantitative risk analysis.
High-level estimation of stability.
Calculation of breakeven levels.
Parameters variation methods: sensitivity analysis and scenario analysis.
Evaluation of the projected effect, subject to quantitative characteristics of uncertainty.

Topic 5. Risk response measures
Additional research and analysis.
Risk taking. Risk avoidance (elimination). Risk transfer.
Risk avoidance (minimization).
Mitigation of risks.
Insurance.
Hedging.

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:
Формы текущего контроля успеваемости: опрос, дискуссия.

Форма промежуточной аттестации, отражающая формирование компетенции на уровне данной дисциплине: зачет.

Этапы освоения компетенции ПК-1.3, ПК-3.2 отражают формирование:

на уровне знаний:

Методы и процедуры контроля деятельности работников и подразделения

Методы, технологии, инструменты совершенствования контроля деятельности работников и подразделения

Национальные и международные документы, стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками

Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками

Методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации

Отечественные и международные стандарты в области финансового планирования

на уровне умений:

Формулировать требования к специалистам по управлению рисками

Владеть методами аудита, оценки и аттестации работников

Проводить идентификацию и анализ проектных рисков, формулировать основные стратегии реагирования на рисковые события

Управлять проектной командой в соответствии с принципами моделей ситуационного лидерства и динамики развития команды

Анализировать изменения корпоративной нормативной базы по вопросам управления рисками

Рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей

Выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля

на уровне навыков:

Определение процедуры контроля деятельности работников и подразделения

Организация процесса предоставления периодических отчетов о выполненных работах от работников подразделения

Контроль выполнения работ и функций работниками подразделения

Разработка регламентов деятельности подразделения по управлению рисками и отдельных работников

Формирование оперативного и тактического плана работ подразделения

Определение требований, задач и планирование деятельности сотрудников подразделения

Реализация плана построения системы управления рисками

Составление перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском

Составление инвестиционного портфеля

Выявление качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах

Основная литература:

1. Алексеенко В.Б Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие/ Алексеенко В.Б., Кутлыева Г.М., Мочалова Ю.И.— Электрон. текстовые данные. М.: Российский университет дружбы народов. 2013. http://www.iprbookshop.ru/22224

2. Балдин К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С.— Электрон. текстовые данные. М.: Дашков и К, 2015. http://www.iprbookshop.ru/14110
3. Воробьев, С.Н. Управление рисками в предпринимательстве, 4-е изд., испр. [Электронный ресурс] : / С.Н. Воробьев, К.В. Балдин. — Электрон. дан. М. : Дашков и К, 2013. http://e.lanbook.com/books/element.php?pl1_id=50264