

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.ДВ.04.01 ПРАКТИЧЕСКИЙ РИСК МЕНЕДЖМЕНТ

Автор: к.т.н., преп. Бирюк В.Г.

Код и наименование направления подготовки: 38.04.02 Менеджмент

Профиль: Управление рисками в корпорациях

Квалификация (степень) выпускника: магистр

Форма обучения: очная.

Цель освоения дисциплины:

Сформировать компетенции

- ПК-3 Способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач
- ПК-6 Способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач

План курса:

Тема 1. Предмет и профессия риск-менеджера

Основы и концепции, практика интеграции риск-менеджмента в деятельность банка и корпорации. Кросс-функциональная роль риск-менеджмента.

(Аутсорсинг риск-менеджмента и риск аутсорсинга). Международные стандарты и подходы в риск-менеджменте. Концепции и резолюции: GARP, PRMIA, RiskDoctor, ЦБР (ВПОДК), EY, KPMG, McKency. Правовое регулирование и процедуры оценки и управления рисками. Российский и зарубежный опыт и подходы к требованиям международных институтов и законодательства

Управление системными рисками – стресс-тесты. Сравнение режимов стресс-тестов среди различных юрисдикций.

Тема. Практика корпоративного риск-менеджмента

Современные подходы (математические и экспертные модели) в управлении рисками.

Кейс 1: Современные риски и кризис туристической отрасли? Предпринимательские риски малого и среднего бизнеса. Репутация менеджмента, прозрачность отчетности и работа в других юрисдикциях.

(Эволюция предпринимательства). Организация системы риск-менеджмента на предприятии (Enterpriserisk-management). SERM. Экономический, социальный и экологический риск-менеджмент.

Искусство управления экономическими и финансовыми показателями.

Кейс 2: риски ликвидности и роста стоимости финансов для энергетической отрасли (на примере «НК Роснефть»). Финансовая диагностика и юридическая экспертиза. Понимание процесса Due Diligence для минимизации рисков.

Тема 3. Банковско-финансовые риски

Риски в кредитных организациях; риски в небанковских финансовых организациях. Кредитный риск, процентный, операционный и другие определяющие риски.

Подходы банка России к оценке качества процедур управления рисками. Риски репутации, «Комплаенс» и преступления в банках и корпорациях. Лучшие практики построения систем противодействия мошенничеству;

Принципы раскрытия информации. DoddFrank, OksleyFATCAect. Реорганизация бизнеса. Проблемные и непрофильные активы. Оценка вероятности дефолта, потерь и ставки восстановления долга (LGD) банка, корпорации.

Построение модели финансового оздоровления.

Кейс 3: Моделирование системы управления рисками при реструктуризации кредитного долга (Банк ВЭБ). Модели оптимизации рисков, IRB-системы (использование и ограничения). Рейтинговые механизмы, VAR, модель COSO.

Кейс 4: Модель оценки стоимостной меры риска. VaR. Современный критерий в финансовом и промышленном секторе. Роль и понятие экономического капитала банка и корпорации. Изменения в регулировании - Пошаговое внедрение в соответствии с Базель II, Базель III

Риск-аппетит и его связь с системой вознаграждения, величиной экономического капитала и нормативов регулятора. ВПОДК; требования к процедуре управления рисками.

Тема 4. Риски на финансовых рынках и инвестиционные инструменты Риск ориентированный подход к инвестиционным стратегиям при работе в различных юрисдикциях.

Кейс 5: Выбор инструмента финансирования (IPO).

Тема 5. Управление рисками в сфере персонала

Стратегии коммуникаций и мотивации работников. Управление поведенческими рисками; влияние человеческой психологии на управление рисками.

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:

В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.04.01 Практический риск менеджмент используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Предмет и профессия риск-менеджера	Опрос, Кейс
Практика корпоративного риск-менеджмента	Кейс
Банковско-финансовые риски	Кейс
Риски на финансовых рынках и инвестиционные инструменты:	Кейс
Управление рисками в сфере персонала предприятия и финансовой организации	Опрос

Промежуточная аттестация проводится в форме зачета с применением следующих методов: письменные ответы на вопросы и решение кейса.

Промежуточная аттестация проводится в форме: зачет.

Основная литература:

1. Барбаумов В.Е., Рогов М.А., Щукин Д.Ф., Ситникова Н.Ю. Энциклопедия финансового риск-менеджмента. Издательство "Альпина Паблишер", 2016.
https://e.lanbook.com/book/95371#book_name
2. Князева Е.Г. [и др.]. Финансово-экономические риски [Электронный ресурс]: учебное пособие/— Электрон. текстовые данные.— Екатеринбург: Уральский федеральный университет, 2015.— 112 с.— Режим доступа:

- <http://www.iprbookshop.ru/68505.html>.— ЭБС «IPRbooks»
3. Слепухина Ю.Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Ю.Э. Слепухина— Электрон. текстовые данные.— Екатеринбург: Уральский федеральный университет, 2015.— 216 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/68289.html>.— ЭБС «IPRbooks»