Приложение 10 ОП ВО

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ ОСНОВЫ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА

Автор: к.ф.-м.н., профессор В.Б. Минасян
Код и наименование направления подготовки: 38.03.02 Менеджмент
Профиль: Финансовый менеджмент
Квалификация (степень) выпускника: бакалавр
Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины:

Сформировать компетенции

- ПК-9 способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли.
- ПК-4 Умение применять основные методы финансового менеджмента для оценки активов, управления оборотным капиталом, принятия инвестиционных решений, решений по финансированию, формированию дивидендной политики и структуры капитала, в том числе, при принятии решений, связанных с операциями на мировых рынках в условиях глобализации.
- ПК-15 Умение проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании.

План курса:

Тема 1. Процесс управления риском. Моделирование факторов риска.

Понятие риска. Сложность определения. Конфликт риска и вознаграждения. Факторы риска и способы их моделирования.

Тема 2. Эволюция задач риск-менеджмента.

Разница между предсказанием и прогнозированием. Распределение потерь. Система показателей, скорректированных на риск. Успехи и неудачи риск-менеджмента за последние десятилетия.

Тема 3. Классификация рисков. Проблемы классификации.

Рыночный риск. Кредитный риск. Риск ликвидности. Операционный риск. Юридический и регуляторный риски. Деловой риск. Стратегический риск. Репутационные риски. Проблемы классификации.

Тема 4. Корпоративный риск-менеджмент. ERM-системы.

Совет директоров и его функции по руководству риск – менеджментом компании. CRO – его права и обязанности по налаживанию системы риск –менеджмента в компании.

Комитеты по рискам и их роль в определении и ограничении уровней рисков. Аудиторский комитет и ее функция по управлению рисками

Тема 5. Регулирование управления рисками. Решения Базельского комитета и их реализация.

Необходимость Базельского соглашения. Важнейшие показатели достаточности капитала. Отношение активов к капиталу и отношение капитала к активам, взвешенным по риску. Кредитный эквивалент для внебалансовых рисков. Три столпа Базельского соглашения.

Тема 6. Ценность под риском. Мера риска VaR.

Определение ценности под риском. Применение VaR на практике. Историческое моделирование. Метод Монте Карло. Стресс тестирование.

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:

В ходе реализации дисциплины «Основы риск-менеджмента» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Процесс управления риском. Моделирование факторов риска.	Опрос
Эволюция задач рис-менеджмента	Опрос
Классификация рисков. Проблемы классификации.	Опрос
Корпоративный риск-менеджмент. ERM-системы.	Контрольное задание
Регулирование управления рисками. Решения Базельского комитета и их реализация.	Опрос
Ценность под риском. Мера риска VaR.	Контрольное задание

Промежуточная аттестация проводится в форме экзамена.

Основная литература:

1. Гэлаи Д., Кроуи М., Минасян В.Б., Марк Р. Основы риск – менеджмента. - М: «ЮРАЙТ», 2014 г. https://www.biblio-online.ru/book/B09D2080-475C-4D6A-A567-EC01EE10B8CD
2. Дамодоран А. Инвестиционная оценка: инструменты и методы оценки любых активов. М.: Альпина Паблишер, 2014 http://www.iprbookshop.ru/68013.html
3. Лимитовский М.А., Лобанова Е.Н., Минасян В.Б., Паламарчук В.П. Корпоративный финансовый менеджмент. Учебно –практическое пособие. - М.: Юрайт, 2014 г. https://www.biblio-online.ru/book/89E2CCAF-62F2-4869-A5A1-15A944DA01BE