

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)/ПРАКТИКИ

Б1.В.ДВ.1.2 _Информационные основы управления рисками при принятии стратегических управленческих решений

(индекс и наименование дисциплины (модуля), в соответствии с учебным планом)

Автор(ы)–составитель(и):

Профессор, док. техн. наук, профессор кафедры прикладных информационных технологий

(ученое звание, ученая степень, должность)

(наименование кафедры)

Горелов В.И.

(Ф.И.О.)

Доцент, канд.. физ.-мат. наук, доцент кафедры прикладных информационных технологий

(ученое звание, ученая степень, должность)

(наименование кафедры)

Тевелева Е.А.

(Ф.И.О.)

Код и наименование направления подготовки, профиля: 38.04.02 Менеджмент "Digital design в менеджменте (информационно-аналитический менеджмент)"

Квалификация (степень) выпускника: Магистр

Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины:

Сформировать следующие компетенции:

способностью разрабатывать корпоративную стратегию, программы организационного развития и изменений и обеспечивать их реализацию (ПК-2);

способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения (ПК-4);

План курса:

Тема 1 Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента

Основные определения и понятия риск-менеджмента. Процессы управления риском. Категории «риск» и «доходность». Основные элементы и этапы управления риском. Манипулирование риском. Глобальные задачи в области управления рисками: применение риск менеджмента; управление рисками по их типам; точность оценок рисков. Функции риск-менеджмента. Организация риск-менеджмента. Понятия: интуиция, инсайт, эвристика. Правила риск-менеджмента. Расчет коэффициента риска. Функции отдела рискованных вложений капитала. Информационное обеспечение функционирования риск-менеджмента. Перечень документов, характеризующих финансовое состояние организации.

Тема 2 Классификация рисков

Классификация рисков по их функциональной направленности. Чистые и спекулятивные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Риски зависимости от основной причины их возникновения. Риски, связанные с покупательной способностью денег. Инвестиционные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Селективные риски. Риск банкротства. Биржевые риски. Транспортный риск - четыре группы по степени ответственности (Е, F, C, D.). Валютный риск. Региональный риск. Отраслевой риск. Инновационный риск. Риски неисполнения хозяйственных договоров. Риски изменения рыночной конъюнктуры и усиления конкуренции. Риски возникновения непредвиденных расходов и снижения

доходов. Риски потери имущества бизнеса. Риск не востребоваемости продукции. Форс-мажорные риски.

Тема 3 Анализ и оценка степени риска

Идентификация и концептуальные направления анализа рисков.

Качественный анализ. Количественной оценки. Этапы идентификации и анализа рисков. Принципы информационного обеспечения системы управления риском. Полезность информации. Эффективность управления риском. Доступность информации.

Достоверность информации. Общие группы источников информации при анализе конкретных рисков. Информационная система, обслуживающая процесс управления рисками. Визуализация рисков. Приемы визуализации рисков. Плотность распределения в связи с реализацией предупредительного мероприятия. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска. Рисковый капитал. Система неопределенностей. Полная неопределенность. Полная определенность. Частичная неопределенность. Критерии определения оптимальности в сфере неопределенности. Определение степени риска. Методы оценки риска: количественный и качественный. Внутренняя норма доходности (IRR); ожидаемая норма доходности (ERR). Коэффициент вариации (CV). Нормальное распределение вероятностей и кривая рисков. Эмпирическая шкала допустимого уровня риска. Кривая рисков. Методы экспертных оценок при определении степени риска. Концепция рисковой стоимости (Value at risk - VAR). Ключевые параметры определения рисковой стоимости (VAR). Объективный метод установления доверительного интервала и временного горизонта. Традиционные техники аппроксимации распределения $R_t(T)$: параметрический метод; моделирование по историческим данным; метод Монте - Карло; анализ сценариев.

Тема 4 Управление рисками, как система менеджмента

Процесс управления рисками в организации и его этапы. Идентификация и анализ риска. Анализ альтернатив управления риском. Методы минимизации негативного влияния неблагоприятных событий. Классификация методов управления рисками. Выбор методов управления риском. Исполнение выбранного метода управления риском. Мониторинг результатов и совершенствование системы управления риском. Методы управления рисками (четыре группы). Методы уклонения от риска. Схема методов управления рисками. Ограничения применения методов управления рисками. Основные реквизиты страхового полиса или свидетельства. Основные контракты, заключаемые при передаче риска. Методы локализации и диссипации риска. Четыре основных вида интеграции, как способ минимизации риска. Диверсификация, как разновидность методов диссипации риска. Виды диверсификации. Методы компенсации риска, как упреждающие методы управления рисками.

Тема 5 Риск-менеджмент в разрезе инвестиционной стратегии. Портфельный менеджмент

Анализ риска в инвестиционной программе с привлечением кредитов. Выбор оптимального инвестиционного проекта. Метод "ПАТТЕРН". График вероятностей периодов погашения кредита. Суммарные значения вероятностей периодов погашения кредита. Двухуровневые вероятности окупаемости программ инвестирования. Расчет совокупных вероятностей периодов окупаемости инвестиций. Совокупные вероятности обобщенных периодов окупаемости в программах инвестирования. Рейтинговые значения двухуровневых вероятностей окупаемости инвестиций. Расчет рейтинговых значений совокупных вероятностей периодов окупаемости инвестиций. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций. Эффективность участия в проекте собственного капитала. Объем собственных средств участника. Объем собственных средств, вкладываемых в проект. Интегральные показатели эффективности. Оценка эффективности: проекта в целом; участия в проекте. Показатели эффективности участия в проекте. Рациональный выбор инвестиционного портфеля. Реальные и финансовые инвестиции. Этапы процесса управления инвестициями. Портфельные

стратегии: активные и пассивные. Диверсифицированный портфель. Кривые безразличия. Рисковые и безрисковые активы. Двухпараметрическая модель Гарри Марковица. Ковариационная матрица. Анализ значений риска портфелей.

В результате освоения дисциплины у студентов должны быть:

ОТФ/ТФ <i>(при наличии профстандарта)/</i> профессиональные действия	Код этапа освоения компетенции	Планируемые результаты обучения при прохождении практик*
Е Стратегическое корпоративное управление рисками Е/01.8 Определение стратегии организации в части развития и поддержании системы управления рисками С/02.7 Консультирование по вопросам управления рисками в организации	ПК-2.1	на уровне знаний: Понятие принципов разработки корпоративной стратегии, программ организационного развития и изменений и обеспечения их реализации.
		на уровне умений: разрабатывать программы организационного развития риск-менеджмента.
		на уровне навыков: внедрения основных этапов и закономерностей исторического развития общества, основных политических и социально-экономических направлений и механизмов, характерных для исторического развития и современного положения России; основные исторические этапы и тенденции развития экологического менеджмента в России и в других странах мира.
С Методическая разработка, поддержание и координация процесса управления рисками С/02.7 Консультирование по вопросам управления рисками в организации	ПК-4.1	на уровне знаний: современных математических методов многомерного статистического анализа, включая методы снижения размерности многомерного пространства, идентификации и распознавания образов, реализацию этих методов в современных пакетах прикладных программ; основных определений, теорем, применяемых в математической статистике;
		на уровне умений: пользоваться математическими методами при изучении и количественном описании реальных процессов и явлений; использовать указанные методы при систематизации и обработки экономической информации с использованием пакетов прикладных программ статистического анализа и прогнозирования.
		на уровне навыков: выработки рациональных решений, применения

ОТФ/ТФ <i>(при наличии профстандарта)/</i> профессиональные действия	Код этапа освоения компетенции	Планируемые результаты обучения при прохождении практик*
		статистических методов в реальной экономической, финансовой и управленческой практике; созданием и исследованием математических моделей явлений, вычислительных процессов, связанных с функционированием объектов профессиональной деятельности

Формы и методы текущего контроля и промежуточной аттестации:

В ходе реализации дисциплины Информационные основы управления рисками при принятии стратегических управленческих решений используются следующие методы текущего контроля и успеваемости обучающихся:

– при проведении занятий лекционного типа:

опрос (О), диспут (Д).

– при проведении занятий семинарского типа:

опрос (О), реферат (Р), диспут (Д).

– при проведении лабораторных и практических занятий:

опрос (О), контрольная работа (КР), реферат (Р), диспут (Д).

Промежуточная аттестация проводится в форме: *Зачета*

Основная литература:

1. Белов П.Г. УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ, СИСТЕМНЫЙ АНАЛИЗ И МОДЕЛИРОВАНИЕ В 2 Т. М: Юрайт, 2014.
2. Н. А. Косолапов ; ред. В. Г. Барановский, Н. И. Иванова ; РАН, Отд-ние глобальных проблем, Ин-т мировой экономики и международных отношений. Глобальное управление: возможности и риски. - М. : ИМЭМО РАН, 2015. - 314 с. - ISBN 978-5-9535-0433-1.