

## **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

### **Б1.В.ОД.10 Управление рисками в малом бизнесе**

**Автор:** Цакаев А.Х., доктор экономических наук, профессор

Олькова А.Е., старший преподаватель кафедры экономики и финансов

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.04.02 Менеджмент  
(Управление в малом бизнесе)

**Квалификация (степень) выпускника:** магистр

**Форма обучения:** очная

#### **Цель освоения дисциплины:**

Сформировать компетенцию в области структуры и содержания стандартов управления рисками в проектной деятельности.

#### **План курса:**

##### **Тема 1.** Содержание процесса управления проектными рисками

Содержание стандартов по управлению рисками: ISO 31000:2009, COSO ERM, FERMA, PMI. Терминология, используемая в стандартах. Подходы к определению понятий «неопределенность» и «риск». Место риск-менеджмента в общей концепции менеджмента проекта. Содержание риск-менеджмента с точки зрения процессного подхода.

##### **Тема 2.** Анализ и оценка проектных рисков

Идентификация рисков как основной элемент системы оценки рисков. Необходимая информация для идентификации рисков. Правила идентификации и описания рисков. Методы идентификации рисков: контрольные листы, РНА, мозговой штурм, метод Дельфи, структурированные интервью. Типовые риски проектов. Группировка и агрегирование рисков. Формирование итогового реестра рисков. Содержание процесса оценки рисков в соответствии с международными стандартами. Оценка вероятности, оценка последствий, оценка присущего риска, оценка остаточного риска, оценка средств управления рисками. Подходы к оценке риска: количественный, полуколичественный, качественный. Методы оценки риска:

- Наблюдение
- Организационные (вспомогательные) методы
- Анализ сценариев
- Анализ функциональности
- Статистические методы
- Анализ средств управления рисками

Визуализация рисков. Диаграмма «рыбий скелет», дерево отказов и дерево событий, диаграмма «галстук-бабочка», диаграмма «торнадо», диаграмма Spider, матрица и карта рисков.

Сравнительный анализ рисков. Определение риск-аппетита и толерантности к риску.

### **Тема 3. Оценка инвестиционного проекта с учетом риска**

Влияние фактора неопределенности на стоимость инвестиционного проекта. Учет неопределенности при расчете чистой дисконтированной стоимости проекта: выбор ставки дисконтирования. Метод building blocks, метод средневзвешенной стоимости капитала. Моделирование распределения NPV проекта имитационными методами. Метод Монте Карло: спецификация модели и процесс симуляции. Диаграмма Торнадо и анализ чувствительности проекта. Оценка стоимости проекта методом дерева решений и методом реальных опционов.

### **Тема 4. Методы управления проектными рисками**

Процесс воздействия на риск организации. Планирование мер по воздействию на источники риска, последствия и вероятность. Избежание (уклонение) риска как метод управления. Передача риска: страхование, хеджирование, партнерские отношения. Минимизация риска: минимизация последствий и минимизация вероятности наступления. Принятие риска: создание резервов и мониторинг. Воздействие на возможности организации.

### **Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:**

Код компетенции	Наименование Компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-2	Способность разрабатывать корпоративную стратегию, программы организационного развития и изменений и обеспечивать их реализацию	ПК-2.2	Обеспечение реализации корпоративной стратегии, программы организационного развития

ПК-4	Способность использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения	ПК-4.3	Способность оценить риски с помощью продвинутых количественных методов
------	--	--------	--

ОТФ/ТФ (при наличии профстандарта)/профессиональные действия	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
<p>Консультирование по вопросам управления рисками в организации</p> <p>Управление кадровым составом системы управления рисками</p> <p>Контроль процесса предоставления отчетности по рискам в организации (профессиональный стандарт «Специалист по управлению рисками»)</p>	ПК-2.2	<p>на уровне знаний:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Возможных угроз и возможностей, существующих для организации в окружающей среде</li> <li>• Современных технологий проведения стратегического анализа</li> <li>• Методов сбора информации для проведения прикладного исследования</li> <li>• Необходимого вида информации для ее дальнейшего анализа путем использования количественных и качественных методов</li> <li>• Содержания методики проведения анализа</li> <li>• Порядка подготовки аналитической информации</li> <li>• Методов и приемов проведения аналитических расчетов</li> </ul>
		<p>на уровне умений:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Формулировать цели и задачи компании</li> <li>• Определять текущее и желаемое положение организации на рынке</li> <li>• Составлять планы компании</li> <li>• Формировать предложения управленческих решений на основе анализа</li> <li>• Строить многофакторные модели</li> <li>• Идентификации специфических проектных рисков</li> <li>• Сценарного анализа проектных рисков</li> <li>• Применения метода Торнадо, диаграммы</li> </ul>

		<p>«Паук», деревья событий и деревья решений в оценке проектных рисков</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Оценивать влияние рисков на проведенное прикладное исследование</li> <li>• Оценивать риски с помощью продвинутых количественных методов</li> <li>• Оценивать влияние рисков на стоимость проекта</li> <li>• Оценивать эффективность принятых мер по управлению рисками</li> </ul> <p>на уровне навыков:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Осуществления стратегического анализа стратегии организации</li> <li>• Разработки стратегии компании</li> <li>• Построения организационно-управленческих моделей в конкретных задачах управления</li> <li>• Оценивать последствия и вероятность с помощью качественных, полуколичественных и количественных методов</li> <li>• Проводить сравнительный анализ риска</li> <li>• Выбирать методы воздействия на риск</li> </ul>
<p>Руководство созданием методологии системы управления рисками, формирование основных принципов корпоративных нормативных актов по управлению рисками</p> <p>Оценка адекватности воздействия на риски (страховой защиты, хеджирования, гарантий)</p> <p>Координация процесса выполнения планов и бюджетов реагирования на риск</p> <p>(профессиональный стандарт «Специалист по управлению рисками»)</p>	ПК-4.3	<p>на уровне знаний:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Место управления рисками в общей системе проект-менеджмента</li> <li>• Источников проектных рисков</li> <li>• Подходов к классификации проектных рисков</li> <li>• Структуры и содержания стандартов управления рисками в проектной деятельности</li> <li>• Подходов к оценке различных типов рисков</li> <li>• Особенности управления рисками проектов разного профиля</li> <li>• Продвинутых методов оценки проектных рисков Методов анализа проектных рисков</li> <li>• Методов управления проектными рисками</li> <li>• Перечня необходимой информации для анализа и оценки рисков</li> <li>• Количественных, полуколичественных и качественных методов оценки риска</li> </ul>

		(последствий и вероятности)
		<p>на уровне умений:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Предлагать управленческие решения</li> <li>• Идентифицировать и классифицировать риски проекта</li> <li>• Проводить сравнительный анализ риска</li> <li>• Выбирать методы воздействия на риск</li> <li>• учета неопределенности и риска в оценке инвестиционных проектов</li> <li>• статистического анализа рисков</li> <li>• применения методов имитационного моделирования в оценке проектных рисков</li> <li>• оценки инвестиционных проектов методом реальных опционов</li> <li>• Применять количественные и качественные методы проведения прикладного исследования</li> <li>• Анализировать полученные результаты</li> <li>• Анализировать структуру и содержание процессов управления</li> <li>• Проводить вербальное описание рисков</li> <li>• Оценивать последствия и вероятность с помощью качественных, полуколичественных и количественных методов</li> </ul>
		<p>на уровне навыков:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Обеспечения контроля за реализацией корпоративной стратегии, программы организационного развития</li> <li>• Подготовки сбалансированных управленческих решений на основе анализа</li> <li>• Проведения анализа исследования количественно и качественно</li> <li>• Оценивать последствия и вероятность с помощью качественных, полуколичественных и количественных</li> </ul>

		<p>методов</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Принятия управленческих решений на основе статистического анализа</li> <li>• Идентифицировать и классифицировать риски проекта</li> <li>• Проводить вербальное описание рисков</li> <li>• Проводить сравнительный анализ риска</li> <li>• Оценивать риски с помощью продвинутых количественных методов</li> <li>• Оценивать влияние рисков на стоимость проекта</li> <li>• Оценивать эффективность принятых мер по управлению рисками</li> </ul>
--	--	--

В ходе реализации дисциплины используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

– при проведении занятий лекционного типа:

- Тест на основные понятия
- Контрольная работа
- Групповое обсуждение
- Тестирование
- Коллоквиум
- Кейс-стади
- Интерактивная презентация

– при проведении занятий практического (семинарского) типа:

- Тестирование с открытыми вопросами
- Отчет, интерактивная презентация
- Контрольная работа
- Групповое обсуждение
- Тестирование
- Интерактивная презентация

Промежуточная аттестация проводится в форме: зачета (в письменной форме на основе выполнения заданий по кейсам).

#### **Основная литература:**

- Белов П.Г. Управление рисками, системный анализ и регулирование, 2016
- Фомичев А.Н. Риск-менеджмент: Учебник. «Дашков и К», 2016