

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.1.3 «Управление рисками»

наименование дисциплин (модуля)

Автор: к.э.н. Пузов Е.Н.

Код и наименование направления подготовки, профиля:

38.04.02 «Менеджмент», профиль «Управление развитием бизнеса (организации)»

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:

Тема 1. Риск: основные понятия и концепции

Конечная цель риск-менеджмента заключается в получении наибольшей выгоды при оптимальном, приемлемом для предпринимателя соотношении доходов, расходов и риска.

Риск-менеджмент представляет собой систему управления риском и экономическими, точнее, финансовыми отношениями, возникающими в процессе этого управления. Риск-менеджмент включает в себя стратегию и тактику управления.

Под стратегией управления понимаются направление и способ использования средств для достижения поставленной цели. Этому способу соответствует определенный набор правил и ограничений для принятия решения. Стратегия позволяет сконцентрировать усилия на вариантах решения, не противоречащих принятой стратегии, отбросив все другие варианты.

Тактика - это конкретные методы и приемы для достижения поставленной цели в конкретных условиях. Задачей тактики управления является выбор оптимального решения и наиболее приемлемых в данной хозяйственной ситуации методов и приемов управления.

Основные понятия: риск и неопределенность, знания и информация, шум и сигнал, прогнозы, международные и российские стандарты и практики управления риском и внутреннего аудита.

Тема 2. Методы оценки рисков (ISO/IEC 31010:2009 «Управление рисками - методы оценки рисков»)

Изучение инструментария и алгоритмов анализа с выполнением самостоятельных заданий.

Анализ и оценка рисков.

1) Идентификация - представляет процесс, при котором выявляется подверженность компании неизвестности, рискам (стратегические, операционные, финансовые, управление знаниями и информацией, регулятивные).

2) Описание - заключается в подробном описании выявленных рисков,

3) Измерение - можно количественным, качественным или смешанным способом.

4) Методы и технологии анализа рисков. Некоторые из них применимы только для положительных или негативных рисков, другие – для всех видов.

5) Карта рисков (Risk Profile).

Качественная/количественная оценка рисков.

Мероприятия по управлению рисками.

Мониторинг.

Основные понятия: анализ сценариев, чувствительности, стресс-тестирование, опциональность и дерево решений, метод Монте Карло, а также прочие методы выявления, оценки и мониторинга рисков

Тема 3. Интегрированная концепция внутреннего контроля и управления рисками Комитета спонсорских организаций Комиссии Тредвея/KOSO 1992, 2004, 2013 (COSO (ERM/IC))

Совместная работа над кейсом «Проектирование системы управления рисками компании».

Основные понятия: 8 компонентов системы управления рисками: внутренняя среда, постановка целей, определение событий, оценка рисков, реагирование на риск, средства контроля, информация и коммуникации, мониторинг.

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:

Формы текущего контроля успеваемости: практические задания.

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

Этап освоения компетенции ПК-1.2, ПК-3.1 отражает формирование:

на уровне знаний:

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

Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками

Принципы построения систем управления рисками

Элементы системы управления рисками и их взаимосвязь

на уровне умений:

Адаптировать элементы системы риск-менеджмента к условиям функционирования организации, а также новым бизнес-процессам и направлениям

Анализировать и применять методики оценки управления рисками и реагирования на риски

Организовывать процесс управления рисками в организации с учетом отраслевых стандартов

Обрабатывать информацию по рискам в отрасли и в организации

Производить диагностику существующей в организации практики управления рисками

Разрабатывать программы по совершенствованию процедур управления рисками в соответствии с лучшими практиками

на уровне навыков:

Построение модели корпоративной системы управления рисками, включающей общую конфигурацию системы, общую схему управления

рисками, принципы организационно-функциональной структуры и информационного обмена

Разработка и внедрение рекомендаций по построению структуры системы управления рисками с учетом международных стандартов корпоративного управления и специфики ведения бизнеса организации

Разработка требований к программному обеспечению по управлению рисками, помощь в выборе автоматизированной системы управления рисками

Основная литература:

1. 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>