

## **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ**

### **Б1.В.ДВ.03.02 ИНТЕГРИРОВАННЫЙ РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ**

**Авторы:** д.э.н. профессор, профессор кафедры теории и систем отраслевого управления Минченкова О.Ю.

старший преподаватель кафедры теории и систем отраслевого управления Бородулин А.Л.

**Код и наименование направления подготовки:** 38.04.02 Менеджмент

**Направленность (профиль):** «Управление производственными системами»

**Квалификация (степень) выпускника:** магистр

**Цель освоения дисциплины:** сформировать способность использовать современные методы анализа и интерпретации финансовой информации

#### **Место дисциплины**

Дисциплина Б1.В.ДВ.03.02 «Интегрированный риск-менеджмент» относится к дисциплинам по выбору вариативной части образовательной программы подготовки магистров по направлению 38.04.02 «Менеджмент» направленности «Управление производственными системами» и изучается в 3 семестре.

#### **Объем дисциплины**

Трудоемкость дисциплины оценивается в 3 ЗЕТ (108 академических часа/81 астрономических часа). На контактную работу с преподавателем в форме лекционных занятий отводится 8 академических часа/6 астрономических часа, в форме практических занятий – 24 академических часа/ 18 астрономических часов. На самостоятельную работу обучающихся отводится 76 академических часов/ 57 астрономических часов.

#### **План курса:**

##### **Тема 1. Риск и неопределенность бизнес-среды.**

Понятие и сущность рисков. Понятие риска в научном и прикладном значениях. Неопределенность и источники риска. Структурная характеристика риска. Психологические аспекты риска. Подходы к классификации рисков. Общие принципы классификации рисков.

##### **Тема 2. Принятие решений в условиях риска**

Принятие решений в условиях неопределенности. Критерий Лапласа, критерий Сэвиджа, критерий Гурвица, минимаксный критерий. Принятие решений в условиях риска. Критерий ожидаемого значения (прибыли или расходов); комбинация ожидаемого значения и дисперсии, критерий предельного уровня; критерий наиболее вероятного исхода. Экспериментальные данные при принятии решений в условиях риска. Деревья решений.

##### **Тема 3. Риск-менеджмент: роль и место в общей системе менеджмента**

Необходимость выявления, анализа и управления рисками предприятия. Понятие и значение интегрированного риска предприятия. Содержание риск-менеджмента в организации. Роль риск-менеджмента в общей системе менеджмента организации. Риски как факторы возникновения кризисных явлений в организации. Организационно-экономические и правовые аспекты возникновения рисков в организациях, и их последствия. Основные задачи риск-менеджмента.

##### **Тема 4. Методы анализа и оценки рисков.**

Качественные методы анализа и оценки рисков. Эволюция теории риска. Основные компоненты методологии риск-менеджмента. Методы анализа и измерения риска в стандартах ISO 31000 и 31010. Экспертные методы анализа рисков. Применение теории игр для оценки рисков.

Статистические показатели риска. Распределение факторов риска. Правило трех сигм. Риск и доходность. Принципы диверсификации. Портфельная теория Марковица. Модель CAPM. Стоимостная оценка риска. VaR-методология

#### **Тема 5. Методы управления рисками**

Общие принципы управления риском. Схема процесса управления риском. Выбор приемов управления риском. Диверсификация. Страхование риска. Хеджирование. Лимитирование. Резервирование средств(самострахование). Качественное управление рисками.

#### **Тема 6. Построение системы риск-менеджмента**

Стратегический анализ деятельности корпорации в целях выработки направлений менеджмента рисков. Особенности жизненного цикла и измерение рискового спектра корпорации в условиях неопределенности. Организационная структура корпоративного риск-менеджмента. Интегрирование элементов риск-менеджмента в бизнес-процессы компании.

Финансирование риска и анализ эффективности риск-менеджмента. Современные методы диагностики рисков корпоративных организаций. Финансирование программы управления рисками.

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

В ходе реализации дисциплины Б1.В.ДВ.03.02 «Интегрированный риск-менеджмент» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

№	Наименование тем и/или разделов	Методы текущего контроля успеваемости
Тема 1	Риск и неопределенность бизнес-среды	Т№1
Тема 2	Принятие решений в условиях риска	ПКР
Тема 3	Риск-менеджмент: роль и место в общей системе менеджмента	Э №1
Тема 4	Методы анализа и оценки рисков	ГТЗ
Тема 5	Методы управления рисками	КТ
Тема 6	Построение системы риск-менеджмента	Э №2

По дисциплине Б1.В.ДВ.03.02 «Интегрированный риск-менеджмент» учебный планом предусмотрен зачет , который проводится в письменной форме.

#### **Основная литература:**

1. Иванов А.А., Олейников С.Я., Бочаров С.А. Риск-менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие. Евразийский открытый институт, 2011. <http://www.iprbookshop.ru/10817>
2. Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие Дашков и К2015 <http://www.iprbookshop.ru/14110>
3. Дармилова Ж.Д. Инновационный менеджмент [Электронный ресурс]: учебное пособие для бакалавров. Дашков и К, 2014. <http://www.iprbookshop.ru/24784>