

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### Б1.В.ДВ.07.01 Риск-менеджмент / Risk Management

**Автор:** к.э.н., доцент кафедры Менеджмента ИБДА А.Н. Павлов

**Код и наименование направления подготовки, профиля:**

38.04.02 менеджмент, Международный менеджмент

**Квалификация (степень) выпускника:** магистр

**Форма обучения:** очная

#### **Цель освоения дисциплины:**

Целью изучения дисциплины «Риск-менеджмент» является развитие способности оценивать конкурентную среду и разрабатывать маркетинговую стратегию предприятия (ПК ОС-12), а также освоение современных методов распознавания, классификации, оценки рисков компании, научиться принимать решения в условиях неопределенности с учетом уровня риска, ознакомиться с основными подходами к управлению рисками и/или их минимизации для достижения целей компании.

Результаты освоения дисциплины:

#### на уровне знаний

- Основные цели риск-менеджмента
- Отличия между неопределённостью и риском
- Основные подходы к управлению рисками
- Основные подходы к построению системы-риск- менеджмента на предприятии
- Модели расчета совокупного риска для компании
- Основные подходы к проведению стресс-тестирования и составления сценариев
- Подходы к максимизации акционерной стоимости
- Модель VAR и особенности ее расчета несколькими методами
- Модель COSO и ее использование
- Модели расчета кредитного риска: CreditMetrics и KMV Portfolio Manager
- Основные методы оценки рисков (VAR, Credit Metrics и т..п.)
- Применимость различных моделей на развивающихся рынках
- Методы математического моделирования, применяемые для оценки рисков

#### на уровне умений

- Выявлять риски в деятельности компании
- Строить карту рисков
- Оценивать последствия рисков для компании
- Рассчитывать совокупный риск для компании
- Определять предельный риск, который компания может принять на свое удержание
- Интерпретировать полученные варианты оценок
- Использовать полученные результаты для управления портфелем рискованных активов
- Использовать полученные результаты оценки для снижения операционных рисков

#### на уровне навыков

- Навыками оценки рисков
- Навыками выявления и минимизации рисков
- Навыками управления капиталом и распределения его на покрытие рисков....

- Навыками сценарного планирования ....
- Навыками расчета риска вложений в рыночные активы
- Навыками оценки и управления операционным риском
- Навыками оценки совокупного риска компании
- Навыками оценки кредитного риска

### **План курса:**

Тема 1 Введение в риск-менеджмент. Роль рисков в деятельности финансовых и нефинансовых предприятий

Тема 2 Рыночные риски

Тема 3 Определение и оценка кредитных рисков

Тема 4 Определение и оценка операционных рисков

Тема 5 Интегрированный риск-менеджмент. Расчет совокупного риска для компании и оценка адекватности капитала.

Тема 6 Стресс-тестирование или оценка максимальных потерь.

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

Формы текущего контроля – контрольная работа, реферат, эссе.

Зачет проводится в форме письменного теста.

### **Основная литература:**

1. Материалы, публикуемые Базельским комитетом, Basel I, Basel II, Basel III
2. «Энциклопедия финансового риск-менеджмента» под редакцией А.А.Лобанова и А.В. Чугунова, 4-е издание, исправленное и дополненное. Москва, Альпина Паблишер, 2019. 1830 с.
3. «Основы риск-менеджмента», Мишель Круи, Дэн Галэй, Марк Роберт М. Издательство: Юрайт, 2019. 392 с.
4. «Управление в условиях неопределённости», Казначеева Э. В., Москва: ВШЭ, 2014. 148 с.
5. «Риски и шансы: неопределенность, прогнозирование и оценка», Мадера А. Г., М., УРСС, 2014. 448 с.
6. М.А. Рогов, «Риск-менеджмент», Москва, Финансы и Статистика, 2001;
7. Воробьев С.Н. Управление рисками в предпринимательстве. -М.: Издательско-торговая корпорация “Дашкова и К”. 2013. 482 с.
8. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент: учебник, М.: Издательство Юрайт, 2018 (ссылка 4627F69F-8A78-4F2B-BA77-0FBA1599D0AC)