

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### **Б1.В.ДВ.01.02 «Управление рисками / Risk Management»**

*наименование дисциплин (модуля)*

**Автор:** к.т.н, доцент Солнцев В.И.

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

38.04.02 «Менеджмент», профиль «Инновационный менеджмент»

**Квалификация (степень) выпускника:** магистр

**Форма обучения:** очная

**Цель освоения дисциплины:** сформировать компетенции в областях 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:**

##### **Topic 1. Introduction to risk management for investment projects**

Course goals and objectives.

Concept of an investment project.

Concept of risk and uncertainty.

Attitude of project participants to risk. Concept of risk minimization and acceptance risk.

Decision-making in the presence of risk.

##### **Topic 2. Methodology and stages of risk management with regard to an investment project**

Stages and arrangement of risk management with regard to an investment project.

Coordination of interests of project participants. Risk management tools.

##### **Topic 3. Identification and qualitative risk analysis**

Information basis of investment project risk analysis.

Approaches to project risks detection.

Systems of project risks classification.

Tools used to detect and perform qualitative analysis of project risks.

##### **Topic 4. Quantitative risk analysis for investment projects**

Criteria applied to evaluate the efficiency of investment projects.

Approaches to quantitative risk analysis.

High-level estimation of stability.

Calculation of breakeven levels.

Parameters variation methods: sensitivity analysis and scenario analysis.

Evaluation of the projected effect, subject to quantitative characteristics of uncertainty.

##### **Topic 5. Risk response measures**

Additional research and analysis.

Risk taking. Risk avoidance (elimination). Risk transfer.

Risk avoidance (minimization).

Mitigation of risks.

Insurance.

Hedging.

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

Формы текущего контроля успеваемости: опрос, дискуссия.

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

Этапы освоения компетенции ПК-1.3, ПК-3.2 отражают формирование:

**на уровне знаний:**

Методы и процедуры контроля деятельности работников и подразделения  
Методы, технологии, инструменты совершенствования контроля деятельности работников и подразделения  
Национальные и международные документы, стандарты, лучшие практики по построению систем управления рисками  
Законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками  
Методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации  
Отечественные и международные стандарты в области финансового планирования

**на уровне умений:**

Формулировать требования к специалистам по управлению рисками  
Владеть методами аудита, оценки и аттестации работников  
Проводить идентификацию и анализ проектных рисков, формулировать основные стратегии реагирования на рискованные события  
Управлять проектной командой в соответствии с принципами моделей ситуационного лидерства и динамики развития команды  
Анализировать изменения корпоративной нормативной базы по вопросам управления рисками  
Рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей  
Выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля

**на уровне навыков:**

Определение процедуры контроля деятельности работников и подразделения  
Организация процесса предоставления периодических отчетов о выполненных работах от работников подразделения  
Контроль выполнения работ и функций работниками подразделения  
Разработка регламентов деятельности подразделения по управлению рисками и отдельных работников  
Формирование оперативного и тактического плана работ подразделения  
Определение требований, задач и планирование деятельности сотрудников подразделения  
Реализация плана построения системы управления рисками  
Составление перечня рекомендаций по управлению инвестиционным риском  
Составление инвестиционного портфеля  
Выявление качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах

**Основная литература:**

1. Алексеенко В.Б. Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие/ Алексеенко В.Б., Кутлыева Г.М., Мочалова Ю.И.— Электрон. текстовые данные. М.: Российский университет дружбы народов. 2013.  
<http://www.iprbookshop.ru/22224>

2. 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>