

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### Риск-ориентированный менеджмент

**Автор:** к.т.н., преподаватель В.Г. Бирюк

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

**Профиль:** Корпоративный финансовый менеджмент

**Квалификация (степень) выпускника:** магистр

**Форма обучения:** очная, очно-заочная, заочная

**Цель освоения дисциплины:**

Сформировать компетенции

**ПК-3 Способность использовать современные методы управления корпоративными финансами для решения стратегических задач**

**ПК-4. Способность использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения**

**План курса:**

№ п/п	Наименование тем (разделов)	Содержание тем (разделов)
Тема 1	Предмет и профессия риск-менеджера	<p>Основы и концепции, практика интеграции риск-менеджмента в деятельность банка и корпорации. Кросс-функциональная роль риск-менеджмента.</p> <p>(Аутсорсинг риск-менеджмента и риск аутсорсинга). Международные стандарты и подходы в риск-менеджменте. Концепции и резолюции: GARP, PRMIA, Risk Doctor, ЦБР (ВПОДК), EY, KPMG, Mc Kency. Правовое регулирование и процедуры оценки и управления рисками. Российский и зарубежный опыт и подходы к требованиям международных институтов и законодательства</p> <p>Управление системными рисками – стресс-тесты. Сравнение режимов стресс-тестов среди различных юрисдикций.</p>
Тема 2	Практика корпоративного риск-менеджмента	<p>Современные подходы (математические и экспертные модели) в управлении рисками.</p> <p>Кейс 1: Современные риски и кризис туристической отрасли? Предпринимательские риски малого и среднего бизнеса. Репутация менеджмента, прозрачность отчетности и работа в других юрисдикциях.</p>

		<p>(Эволюция предпринимательства). Организация системы риск-менеджмента на предприятии (Enterprise risk-management). SERM. Экономический, социальный и экологический риск-менеджмент.</p> <p>Искусство управления экономическими и финансовыми показателями.</p> <p><i>Кейс 2: риски ликвидности и роста стоимости финансов для энергетической отрасли (на примере «НК Роснефть»).</i> Финансовая диагностика и юридическая экспертиза. Понимание процесса Due Diligence для минимизации рисков.</p>
Тема 3	Банковско-финансовые риски	<p>Риски в кредитных организациях; риски в небанковских финансовых организациях Кредитный риск, процентный, операционный и другие определяющие риски.</p> <p>Подходы банка России к оценке качества процедур управления рисками. Риски репутации, «Комплаенс» и преступления в банках и корпорациях. Лучшие практики построения систем противодействия мошенничеству;</p> <p>Принципы раскрытия информации. Dodd Frank, Oksley FATCA ect. Реорганизация бизнеса. Проблемные и непрофильные активы. Оценка вероятности дефолта, потерь и ставки восстановления долга (LGD) банка, корпорации.</p> <p>Построение модели финансового оздоровления.</p> <p>Кейс 3: Моделирование системы управления рисками при реструктуризации кредитного долга (Банк ВЭБ). Модели оптимизации рисков, IRB-системы</p> <p>(использование и ограничения). Рейтинговые механизмы, VAR, модель COSO.</p> <p>Кейс 4: Модель оценки стоимостной меры риска. VaR. Современный критерий в финансовом и промышленном секторе. Роль и понятие экономического капитала банка и корпорации. Изменения в регулировании - Пошаговое внедрение в соответствии с Базель II, Базель III</p> <p>Риск-аппетит и его связь с системой вознаграждения, величиной экономического капитала и нормативов регулятора. ВПОДК; требования к процедуре управления рисками.</p>
Тема 4	Риски на финансовых рынках и инвестиционные инструменты	<p>Риск ориентированный подход к инвестиционным стратегиям при работе в различных юрисдикциях.</p> <p><i>Кейс 5: Выбор инструмента финансирования (IPO).</i></p>
Тема 5	Управление рисками в сфере персонала	<p>Стратегии коммуникаций и мотивации работников. Управление поведенческими рисками; влияние человеческой психологии на управление рисками.</p>

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

- при проведении занятий лекционного типа: опрос(О);
- при проведении занятий практического типа: обсуждение кейсов(К).

**Аттестация проводится с применением следующих методов: письменное тестирование.**

**Основная литература:**

1. Барбаумов В.Е., Рогов М.А., Щукин Д.Ф., Ситникова Н.Ю. Энциклопедия финансового риск-менеджмента. Издательство "Альпина Паблишер", 2016.  
[https://e.lanbook.com/book/95371#book\\_name](https://e.lanbook.com/book/95371#book_name)
2. Князева Е.Г. [и др.]. Финансово-экономические риски [Электронный ресурс]: учебное пособие/— Электрон. текстовые данные.— Екатеринбург: Уральский федеральный университет, 2015.— 112 с.— Режим доступа:  
<http://www.iprbookshop.ru/68505.html>.— ЭБС «IPRbooks»
3. Слепухина Ю.Э. Риск-менеджмент на финансовых рынках [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Ю.Э. Слепухина— Электрон. текстовые данные.— Екатеринбург: Уральский федеральный университет, 2015.— 216 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/68289.html>.— ЭБС «IPRbooks»