

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.08 Управление рисками в малом бизнесе

Автор: Цакаев А.Х., доктор экономических наук, профессор, Олькова А.Е., старший преподаватель кафедры экономики и финансов

Код и наименование направления подготовки, профиля: 38.04.02 Менеджмент (Управление в малом бизнесе)

Квалификация (степень) выпускника: магистр

Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины:

Сформировать компетенцию в области структуры и содержания стандартов управления рисками в проектной деятельности.

План курса:

Тема 1. Содержание процесса управления проектными рисками

Содержание стандартов по управлению рисками: ISO 31000:2009, COSO ERM, FERMA, PMI. Терминология, используемая в стандартах. Подходы к определению понятий «неопределенность» и «риск». Место риск-менеджмента в общей концепции менеджмента проекта. Содержание риск-менеджмента с точки зрения процессного подхода.

Тема 2. Анализ и оценка проектных рисков

Идентификация рисков как основной элемент системы оценки рисков. Необходимая информация для идентификации рисков. Правила идентификации и описания рисков. Методы идентификации рисков: контрольные листы, РНА, мозговой штурм, метод Дельфи, структурированные интервью. Типовые риски проектов. Группировка и агрегирование рисков. Формирование итогового реестра рисков. Содержание процесса оценки рисков в соответствии с международными стандартами. Оценка вероятности, оценка последствий, оценка присущего риска, оценка остаточного риска, оценка средств управления рисками. Подходы к оценке риска: количественный, полуколичественный, качественный. Методы оценки риска: наблюдение, организационные (вспомогательные) методы, анализ сценариев, анализ функциональности, статистические методы, анализ средств управления рисками. Визуализация рисков. Диаграмма «рыбий скелет», дерево отказов и дерево событий, диаграмма «галстук-бабочка», диаграмма «торнадо», диаграмма Spider, матрица и карта рисков. Сравнительный анализ рисков. Определение риск-аппетита и толерантности к риску.

Тема 3. Оценка инвестиционного проекта с учетом риска

Влияние фактора неопределенности на стоимость инвестиционного проекта. Учет неопределенности при расчете чистой дисконтированной стоимости проекта: выбор ставки дисконтирования. Метод building blocks, метод средневзвешенной стоимости капитала. Моделирование распределения NPV проекта имитационными методами. Метод Монте Карло: спецификация модели и процесс симуляции. Диаграмма Торнадо и анализ чувствительности проекта. Оценка стоимости проекта методом дерева решений и методом реальных опционов.

Тема 4. Методы управления проектными рисками

Процесс воздействия на риск организации. Планирование мер по воздействию на источники риска, последствия и вероятность. Избежание (уклонение) риска как метод управления. Передача риска: страхование, хеджирование, партнерские отношения. Минимизация риска: минимизация последствий и минимизация вероятности наступления. Принятие риска: создание резервов и мониторинг. Воздействие на возможности организации.

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
ПК-2	Способность разрабатывать корпоративную стратегию, программы организационного развития и изменений и обеспечивать их реализацию	ПК-2.2	Обеспечение реализации корпоративной стратегии, программы организационного развития
ПК-4	Способность использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения	ПК-4.3	Способность оценить риски с помощью продвинутых количественных методов

ОТФ/ТФ (при наличии профстандарта)/профессиональные действия	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
Консультирование по вопросам управления рисками в организации. Управление кадровым составом системы управления рисками. Контроль процесса предоставления отчетности по рискам в организации (профессиональный стандарт «Специалист по управлению рисками»).	ПК-2.2	на уровне знаний: знание возможных угроз и возможностей, существующих для организации в окружающей среде; знание современных технологий проведения стратегического анализа; знание методов сбора информации для проведения прикладного исследования; знание необходимого вида информации для ее дальнейшего анализа путем использования количественных и качественных методов; знание содержания методики проведения анализа; знание порядка подготовки аналитической информации; знание методов и приемов проведения аналитических расчетов.

		<p>на уровне умений:</p> <p>умение формулировать цели и задачи компании; умение определять текущее и желаемое положение организации на рынке; умение составлять планы компании; умение формировать предложения управленческих решений на основе анализа; умение строить многофакторные модели; умение идентифицировать специфические проектные риски; умение проводить сценарный анализ проектных рисков; умение применять метод Торнадо, диаграмму «Паук», дерево событий и дерево решений в оценке проектных рисков; умение оценивать влияние рисков на проведенное прикладное исследование; умение оценивать риски с помощью продвинутых количественных методов; умение оценивать влияние рисков на стоимость проекта; умение оценивать эффективность принятых мер по управлению рисками.</p> <p>на уровне навыков:</p> <p>навык осуществления стратегического анализа стратегии организации; навык разработки стратегии компании; навык построения организационно-управленческих моделей в конкретных задачах управления; навык оценки последствий и вероятности с помощью качественных, полуколичественных и количественных методов; навык проводить сравнительный анализ риска; навык выбирать методы воздействия на риск.</p>
<p>Руководство созданием методологии системы управления рисками, формирование основных принципов корпоративных нормативных актов по управлению рисками.</p> <p>Оценка адекватности воздействия на риски (страховой защиты, хеджирования, гарантий).</p> <p>Координация процесса выполнения планов и бюджетов реагирования на риск.</p> <p>(профессиональный стандарт «Специалист по управлению рисками»).</p>	ПК-4.3	<p>на уровне знаний:</p> <p>знание места управления рисками в общей системе проджект-менеджмента знание источников проектных рисков; знание подходов к классификации проектных рисков; знание структуры и содержания стандартов управления рисками в проектной деятельности; знание подходов к оценке различных типов рисков; знание особенностей управления рисками проектов разного профиля; знание продвинутых методов оценки проектных рисков; знание методов управления проектными рисками; знание перечня необходимой информации для анализа и оценки рисков; знание количественных, полуколичественных и качественных методов оценки риска (последствий и вероятности).</p> <p>на уровне умений:</p> <p>умение предлагать управленческие решения; умение идентифицировать и классифицировать риски проекта; умение проводить сравнительный анализ риска; умение выбирать методы воздействия на риск; умение учитывать неопределённость и риск в оценке инвестиционных проектов; умение проводить статистический анализ рисков; умение применять методы имитационного моделирования в оценке проектных рисков; умение оценивать инвестиционные проекты методом реальных опционов; умение применять количественные и качественные методы</p>

		<p>проведения прикладного исследования; умение анализировать полученные результаты; умение анализировать структуру и содержание процессов управления; умение проводить вербальное описание рисков; умение оценивать последствия и вероятность с помощью качественных, полуколичественных и количественных методов.</p> <p>на уровне навыков: навык обеспечения контроля за реализацией корпоративной стратегии, программы организационного развития; навык подготовки сбалансированных управленческих решений на основе анализа; навык проведения анализа исследования количественно и качественно; навык оценивать последствия и вероятность с помощью качественных, полуколичественных и количественных методов; навык принятия управленческих решений на основе статистического анализа. навык идентифицировать и классифицировать риски проекта; навык проводить вербальное описание рисков; навык проводить сравнительный анализ риска; навык оценивать риски с помощью продвинутых количественных методов навык оценивать влияние рисков на стоимость проекта; навык оценивать эффективность принятых мер по управлению рисками.</p>
--	--	--

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

– при проведении занятий лекционного типа:

- Тест на основные понятия;
- Контрольная работа;
- Групповое обсуждение;
- Тестирование;
- Коллоквиум;
- Кейс-стади;
- Интерактивная презентация.

– при проведении занятий практического (семинарского) типа:

- Тестирование с открытыми вопросами;
- Отчёт, интерактивная презентация;
- Контрольная работа;
- Групповое обсуждение;
- Тестирование.

Промежуточная аттестация проводится в форме: экзамена в письменной форме (выполнение заданий по кейсам).

Основная литература:1

- Белов П.Г. Управление рисками, системный анализ и регулирование, 2016
- Фомичев А.Н. Риск-менеджмент: Учебник. «Дашков и К», 2016