

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

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>