

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### **Б1.В.ДВ.08.01 «Управление рисками»**

*наименование дисциплин (модуля)*

**Автор:** к.э.н. Пузов Е.Н.

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

38.04.02 «Менеджмент», профиль «Управление развитием бизнеса (организации)»

**Квалификация (степень) выпускника:** магистр

**Форма обучения:** очная

**Цель освоения дисциплины:** сформировать компетенцию в области оценки конкурентной среды и разработки маркетинговой стратегии предприятия (ПК ОС-12)

#### **План курса:**

##### **Тема 1. Риск: основные понятия и концепции**

Конечная цель риск-менеджмента заключается в получении наибольшей выгоды при оптимальном, приемлемом для предпринимателя соотношении доходов, расходов и риска.

Риск-менеджмент представляет собой систему управления риском и экономическими, точнее, финансовыми отношениями, возникающими в процессе этого управления. Риск-менеджмент включает в себя стратегию и тактику управления.

Под стратегией управления понимаются направление и способ использования средств для достижения поставленной цели. Этому способу соответствует определенный набор правил и ограничений для принятия решения. Стратегия позволяет сконцентрировать усилия на вариантах решения, не противоречащих принятой стратегии, отбросив все другие варианты.

Тактика - это конкретные методы и приемы для достижения поставленной цели в конкретных условиях. Задачей тактики управления является выбор оптимального решения и наиболее приемлемых в данной хозяйственной ситуации методов и приемов управления.

Основные понятия: риск и неопределенность, знания и информация, шум и сигнал, прогнозы, международные и российские стандарты и практики управления риском и внутреннего аудита.

##### **Тема 2. Методы оценки рисков (ISO/IEC 31010:2009 «Управление рисками - методы оценки рисков»)**

Изучение инструментария и алгоритмов анализа с выполнением самостоятельных заданий.

Анализ и оценка рисков.

1) Идентификация - представляет процесс, при котором выявляется подверженность компании неизвестности, рискам (стратегические, операционные, финансовые, управление знаниями и информацией, регулятивные).

2) Описание - заключается в подробном описании выявленных рисков,

3) Измерение - можно количественным, качественным или смешанным способом.

4) Методы и технологии анализа рисков. Некоторые из них применимы только для положительных или негативных рисков, другие – для всех видов.

5) Карта рисков (Risk Profile).

Качественная/количественная оценка рисков.

Мероприятия по управлению рисками.

Мониторинг.

Основные понятия: анализ сценариев, чувствительности, стресс-тестирование, опциональность и дерево решений, метод Монте Карло, а также прочие методы выявления, оценки и мониторинга рисков

**Тема 3. Интегрированная концепция внутреннего контроля и управления рисками Комитета спонсорских организаций Комиссии Тредвея/КОСО 1992, 2004, 2013 (COSO (ERM/IC))**

Совместная работа над кейсом «Проектирование системы управления рисками компании».

Основные понятия: 8 компонентов системы управления рисками: внутренняя среда, постановка целей, определение событий, оценка рисков, реагирование на риск, средства контроля, информация и коммуникации, мониторинг.

**Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:**

Формы текущего контроля успеваемости: практические задания.

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

**Основная литература:**

1. 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>