

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
ПКс-3	Владение навыками количественного и качественного анализа информации при принятии управленческих решений, построения экономических, финансовых и организационно-управленческих моделей путем их адаптации к конкретным задачам управления	ПКс-3.2	Способность построения экономических, финансовых и организационно-управленческих моделей путем их адаптации к конкретным задачам управления.
ПКс-5	Умение применять основные принципы и стандарты финансового учета для формирования учетной политики и финансовой отчетности организации, навыков управления затратами и принятия решений на основе данных управленческого учета	ПК-5.2	Способность принимать управленческие решения на основе данных управленческого учета, применения принципов и стандартов финансового учета для формирования учетной политики и финансовой отчетности организации, навыков управления затратами.

ОТФ/ТФ (при наличии)	Код этапа	Результаты обучения
----------------------	-----------	---------------------

профстандарта)/профессиональные действия	освоения компетенции	
<p>Финансовым консультированием по широкому спектру финансовых услуг (профессиональный стандарт «Специалист по финансовому консультированию», Приказ Минтруда России №167н, от 19.03.2015)</p>	ПКс-3.2	<p>на уровне знаний:</p> <ul style="list-style-type: none"> • знание методов и критериев оценки деловой среды в работах отечественных и зарубежных исследователей; • знание особенностей национальных моделей экономического развития; • применяет знания основных этапов развития практики менеджмента, множество теорий и концепций менеджмента. <p>на уровне умений:</p> <ul style="list-style-type: none"> • умение понимать аргументацию и выводы исследователей актуальных проблем менеджмента; • умение выделять общее и особенное в моделях национальной экономики; • оценивает риски и возможные экономические последствия. <p>на уровне навыков:</p> <ul style="list-style-type: none"> • навык владения иностранным (английским) языком; • навык аналитической деятельности и владение методикой оценки результатов развития национальной экономики; • применяет аналитические и численные методы решения задач оптимального управления, а также применяет навыки практического анализа адекватности построенных решений.
<p>Разработкой финансового плана для клиента и целевого инвестиционного портфеля (профессиональный стандарт «Специалист по финансовому консультированию», Приказ Минтруда России №167н, от 19.03.2015)</p>	ПКс-5.2	<p>на уровне знаний:</p> <ul style="list-style-type: none"> • знание теоретико-методологических основ, форм, методов формирования портфеля проектов и управления портфелем проектов; • знание необходимых и достаточных условий, требуемых для подготовки и реализации инвестиционных проектов;

		<ul style="list-style-type: none"> • согласовывает результаты оценки бизнеса различными методами. <p>на уровне умений:</p> <ul style="list-style-type: none"> • умение самостоятельно использовать полученные знания и навыки при формулировании целей и задач предприятия, при определении основных направлений формирования портфеля проектов; • умение составлять краткосрочные и долгосрочные планы для структурных единиц организации; • определяет существующие недостатки в организационной структуре управления организации и формулирует предложения по их устранению. <p>на уровне навыков:</p> <ul style="list-style-type: none"> • навык составления программы организационного развития в соответствии с корпоративной стратегией фирмы; • навык оценки рисков предлагаемого к реализации проекта; • принимает решения по финансированию, формирует дивидендную политику, осуществляет оценку активов, разработку структуры капитала, оптимизацию структуры источников финансирования конкретного инвестиционного проекта.
--	--	--

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 практической подготовки:
- 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

1. Бусов В.И. Теория и практика принятия управленческих решений: учебник и практикум для вузов. Москва: Издательство Юрайт, 2020. Текст: электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/450352>
2. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469401>
3. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/469020>