Министерство науки и высшего образования Российской Федерации

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Сибирский государственный индустриальный университет»

Кафедра менеджмента и отраслевой экономики

УТВЕРЖДАЮ
Директор института экономики
и менеджмента
_____ В.В. Шипунова
подпись
«____» _____ 20___ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Риск-менеджмент

38.03.02 «Менеджмент»
(направленность (профиль): «Менеджмент организации»)

Квалификация выпускника
Бакалавр

Форма обучения
Очно-заочная форма

Срок обучения: 4 года 6 месяцев

Год начала подготовки 2023

Новокузнецк
2023

СибГИУ
Подлинник электронного документа хранится в системе электронного согласования документов СибГИУ
ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭП
Сертификат: 861a8d56fc2cfb6de53bd665403c592fd02b1419
Владелец: Ректор Юрьев Алексей Борисович
Действителен: с 12 февраля 2024 г. по 7 мая 2025 г.
Дата и время: 01-03-2024 00:47:36 ПРОВЕРИТЬ ПОДПИСЬ

1 Цели и задачи освоения учебной дисциплины

Целями учебной дисциплины являются:

– формирование у обучающихся устойчивых фундаментальных знаний и развитие практических навыков в области риск-менеджмента.

Задачами учебной дисциплины являются:

– раскрыть содержание деятельности по управлению рисками;
– определить цели, задачи и функции риск-менеджмента;
– описать особенности принятия управленческих решений в области управления рисками;
– дать характеристику научного инструментария и методологии, используемых в процессе управления рисками;
– ознакомить с особенностями формирования и функционирования службы риск-менеджмента в организации;
– научить обучающихся понимать причины возникновения рисковых ситуаций, закономерности их развития, выбирать эффективные методы противодействия этому развитию, выполнять оценку степени риска и неопределенности при принятии решений в различных сферах хозяйственной деятельности организации, разрабатывать программу управления рисками.

2 Место учебной дисциплины в структуре ООП по направлению подготовки (специальности)

Учебная дисциплина относится к учебным дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 38.03.02 «Менеджмент».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

– Основы интеллектуального труда и управление временем;
– Основы планирования профессиональной деятельности;
– Управление операциями на фондовом рынке;
– Операционный менеджмент;
– Управление инвестициями;
– Безопасность жизнедеятельности;
– Основы проектной деятельности;
– Экономическая теория;
– Экономика организации;
– Менеджмент;
– Управление социальным развитием организации;
– Математические методы в экономике;
– Финансовое планирование;
– Налоговый менеджмент;

– Банковский менеджмент;
– Проектная деятельность 1;
– Проектная деятельность 2;
– Противодействие коррупции.

Учебная дисциплина дополняет знания, умения и навыки, получаемые по одновременно изучаемым и последующим дисциплинам:

– Антикризисное управление;
– Бизнес планирование;
– Преддипломная практика;
– Выполнение и защита выпускной квалификационной работы.

3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– Профессиональные компетенции

Наименование категории (группы) ПК	Код и наименование ПК	Код и наименование индикатора достижения ПК	Планируемые результаты обучения
	ПК-4: Способен разрабатывать мероприятия по воздействию на отдельные виды рисков и проводить их экономическую оценку	ПК-4.1 Выбирает методы оценки рисков	– знать: методы оценки рисков. – уметь: сравнивать методы оценки рисков. – владеть: навыками выделения преимуществ и недостатков методов оценки рисков; навыками отбора подходящих методов оценки рисков.
		ПК-4.2 Проводит анализ и оценку рисков	– знать: методологию и нормативно-правовых основы идентификации и оценки рисков . – уметь: осуществлять расчеты, прогнозировать уровень риска при принятии решений об инвестировании и финансировании. – владеть: навыками анализа рисков реальных и финансовых инвестиций.
		ПК-4.3 Разрабатывает	– знать: критерии,

		мероприятия по управлению рисками	применяемые при выработке варианта управленческого решения по воздействию на риски . – уметь: предлагать решения по воздействию на отдельные виды рисков с учетом их результативности и экономической эффективности. – владеть: навыками выбора оптимального варианта управленческого решения в области риск-менеджмента.

– Универсальные компетенции

Наименование категории (группы) УК	Код и наименование УК	Код и наименование индикатора достижения УК	Планируемые результаты обучения
Системное и критическое мышление	УК-1: Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	УК-1.3 Анализирует предлагаемые варианты решения задачи, оценивает их достоинства и недостатки	– знать: законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками, базовые положения международных стандартов по риск-менеджменту. – уметь: сравнивать различные варианты инвестирования с учетом риска, применять системный подход при решении задач риск-менеджмента. – владеть: навыками сравнения вариантов инвестирования.

4 Объем и содержание учебной дисциплины

Учебные занятия по учебной дисциплине проводятся в форме контактной работы и в форме самостоятельной работы обучающихся.

Контактная работа включает в себя занятия лекционного типа (лекции), занятия семинарского типа (семинары, практические занятия, практикумы), промежуточную аттестацию обучающихся и иные формы взаимодействия обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации ООП на иных условиях, в том числе при проведении промежуточной аттестации обучающихся. Контактная работа может проводиться с применением электронного обучения, дистанционных образовательных технологий.

Объем учебной дисциплины

Семестр / курс		***ИТОГО***	***9 семестр***
Форма промежуточной аттестации			*экзамен*
Трудоёмкость	*академ. час.*	***108***	*108*
	зачетных единиц	***3***	*3*
Лекции, *академ. час.*		***8***	*8*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Лабораторные работы, *академ. час.*		***0***	*0*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Практические занятия, *академ. час.*		***8***	*8*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Курсовая работа / проект, *академ. час.*		***0***	*0*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Консультации, *академ. час.*		***0***	*0*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Самостоятельная работа, *академ. час.*		***74***	*74*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Контроль, *академ. час.*		***18***	*18*
в форме практической подготовки		***0***	*0*

Содержание учебной дисциплины

Раздел 1 Теоретические основы управления рисками;

Тема 1.1 Аксиомы, законы и принципы риск менеджмента (Актуальность изучения управления рисками. Определение риск-менеджмента, ключевые составляющие понятия «риск-менеджмент». Аксиомы риск-менеджмента. Законы управления рисками: общие и специфические. Принципы управления рисками в системе принципов менеджмента.);

Тема 1.2 Понятие и классификация рисков (Риски окружающего мира. Риск и неопределенность: информационный и оценочный подходы к разграничению понятий. Объективное и субъективное понимание риска.

Основные характеристики рисков: экономическая природа, объективность проявления, вероятность возникновения, неопределенность последствий, ожидаемая неблагоприятность последствий, вариабельность уровня, субъективность оценки, наличие

анализа, значимость.
Понятие экономического риска. Риски в производственной, финансовой и коммерческой деятельности.
Классификация рисков. Факторы и причины риска);

Тема 1.3 Процесс риск-менеджмента (Обмен информацией и консультирование с внешними и внутренними заинтересованными сторонами по вопросам риск-менеджмента. Определение ситуации (контекста). Оценка риска (идентификация риска, анализ риска, оценивание риска). Воздействие на риск (выбор вариантов воздействия на риск, подготовка и реализация планов воздействия на ров). иск). Мониторинг и пересмотр (мониторинг и повторная оценка риска). Регистрация процесса риск-менеджмента (ведение документации по результатам реализации процесса риск-менеджмента));

Тема 1.4 Методы оценки риска (Основные методы и приемы оценки риска (краткий обзор, область применения, входные данные, процесс выполнения метода, выход-ные данные, преимущества и недостатки метода). Типы методов оценки рисков (методы наблюдения, вспомогательные методы, функ-циональный анализ, статистические методы). Выбор метода оценки риска для конкретной ситуации. Применимость метода оценки риска. Факторы, влияющие на выбор метода оценки риска);

Раздел 2 2 Управление рисками как сфера профессионального менеджмента;

Тема 2.1 Общая характеристика системы управления рисками (Логика построения системы управления рисками, основные эле-менты этой системы. Свойства системы управления рисками: систем-ный характер управления рисками, сложная структура системы управления рисками, результативность системы управления рисками.
Основные принципы построения системы управления рисками);

Тема 2.2 Управление риском как часть общего менеджмента организации (Управление риском и стратегия организации. Взаимосвязь развития организации и соответствующих вариантов управления рисками.
Управление риском и организационная структура управления компанией.
Аутсорсинг управления риском);

Тема 2.3 Цели и задачи системы управления рисками (Цели системы управления рисками: главные и вспомогательные. Требования к целям управления рисками. Задачи системы управления рисками. Взаимосвязь основных групп задач системы управления рисками);

Тема 2.4 Ограничения системы управления рисками (Внешние ограничения системы управления рисками: законодательные, конъюнктурные и связанные с обязательствами фирмы.
Внутренние ограничения системы управления рисками: институциональные, бюджетные, организационные);

Тема 2.5 Организация управления рисками (Понятие портфеля рисков. Специфика управления портфелем рисков. Два уровня исследования рисков. Управление рисками как динамический процесс. Организационная структура управления рисками. Функции отдела по управлению рисками и риск-менеджера организации. Основные документы, регламентирующие управление рисками на предприятии: «Положение по управлению рисками» и «Руководство по управлению рисками». Их содержание и особенности составления);

Раздел 3 Анализ, оценка и прогнозирование рисков;

Тема 3.1 Оценка рисков финансовых активов (Риск и доходность отдельных активов. Риск и доходность портфеля активов.);

Тема 3.2 Учет риска при анализе инвестиционных проектов (Метод корректировки нормы дисконта. Метод корректировки параметров проекта. Метод достоверных эквивалентов. Анализ чувствительности критериев эффективности проекта. Метод сценариев. Анализ вероятностных распределений потоков платежей. Анализ риска проекта с использованием «дерева решений» (или метода предпочтительного состояния). Имитационное моделирование инвестиционных рисков).

5 Перечень тем лекций

№ раздела / темы дисциплины	**Темы лекций**	**Трудоемкость, *академ.час***	
		всего	**в форме практической подготовки**
Тема 1.1.	Аксиомы, законы и принципы риск менеджмента	1	
Тема 1.2.	Понятие и классификация рисков	1	
Тема 1.3.	Процесс риск-менеджмента	1	
Тема 1.4.	Методы оценки риска	1	
Тема 2.1.	Общая характеристика системы управления рисками	1	
Тема 2.2.	Управление риском как часть общего менеджмента организации	1	
Тема 2.3.	Цели и задачи системы управления рисками	1	
Тема 2.4.	Ограничения системы управления рисками	1	
Итого:		**8**	**0**

6 Перечень тем практических занятий (семинаров)

№ раздела / темы дисциплины	Темы практических занятий (семинаров)	Трудоемкость, *академ.час*	
		всего	**в форме практической подготовки**
Тема 3.1.	Количественная оценка рисков финансовых активов, портфеля финансовых активов	4	
Тема 3.2.	Учет риска при анализе инвестиционных проектов	4	
Итого:		**8**	**0**

7 Перечень тем лабораторных работ

№ раздела / темы дисциплины	Темы лабораторных работ	Трудоемкость, *академ.час*	
		всего	**в форме практической подготовки**
	Отсутствуют		
Итого:		**0**	**0**

8 Перечень тем курсовых работ (проектов)

№ раздела / темы дисциплины	Темы курсовых работ (проектов)	Трудоемкость, *академ.час*	
		всего	**в форме практической подготовки**
	Отсутствуют		
Итого:		**0**	**0**

9 Виды самостоятельной работы

№ раздела / темы дисциплины	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость, *академ.час*	
		всего	**в форме практической подготовки**
Раздел 1.	1. Выполнение домашнего задания; 2. Изучение лекционного материала; 3. Изучение теоретического материала; 4. Прохождение тестирования.	22	
Раздел 2.	1. Изучение лекционного материала; 2. Изучение теоретического материала; 3. Прохождение тестирования.	20	

Раздел 3.	1. Выполнение домашнего задания; 2. Изучение теоретического материала; 3. Подготовка к практическому занятию.	32	
Контроль	*Подготовка к экзамену*	18	
Итого:		**92**	**0**

10 Учебно-методическое и информационное обеспечение учебной дисциплины

а) литература:

1 Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для вузов / А. В. Воронцовский. — 2-е изд. — Москва : Юрайт, 2022. — 485 с. — ISBN 978-5-534-12206-0. – URL: https://urait.ru/bcode/489580 (дата обращения: 02.05.2023);

2 Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. – 2-е изд., перераб. и доп. – Москва : Юрайт, 2019. – 365 с. – ISBN 978-5-9916-3502-8. – URL: https://urait.ru/bcode/432176 (дата обращения: 02.05.2023);

3 Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебное пособие для вузов / В. Е. Шкурко ; под научной редакцией А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва : Юрайт, 2022. — 182 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-05843-7. – URL: https://urait.ru/book/upravlenie-riskami-proekta-493673 (дата обращения: 02.05.2023);

4 Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 1 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Юрайт, 2022. — 211 с. — ISBN 978-5-534-02606-1. – URL: https://urait.ru/bcode/490634 (дата обращения: 02.05.2023);

5 Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 2 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Юрайт, 2022. — 250 с. — ISBN 978-5-534-02608-5. – URL: https://urait.ru/bcode/490635 (дата обращения: 02.05.2023);

6 Белов, П. Г. Управление рисками, системный анализ и моделирование в 3 ч. Часть 3 : учебник и практикум для вузов / П. Г. Белов. — Москва : Юрайт, 2022. — 272 с. — ISBN 978-5-534-02609-2. – URL: https://urait.ru/bcode/490636 (дата обращения: 02.05.2023);

7 Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций : учебное пособие / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. — 12-е изд., перераб. — Москва : Дашков и К, 2023. — 538 с. — ISBN 978-5-394-05412-9. – URL: https://e.lanbook.com/book/316010 (дата обращения: 02.05.2023).

б) ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

1 Консультант студента : электронно-библиотечная система / ООО «КОНСУЛЬТАНТ СТУДЕНТА». – Москва, [200 –]. – URL: http://www.studentlibrary.ru. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

2 ЛАНЬ : электронно-библиотечная система : [коллекция «Инженерно-технические науки»] / ООО «Издательство ЛАНЬ». – Санкт-Петербург, [200 –]. – URL: http://e.lanbook.com. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

3 НАУЧНАЯ ЭЛЕКТРОННАЯ БИБЛИОТЕКА eLIBRARY.RU : база данных / ООО «НЭБ». – Москва, [200 –]. – URL: http://elibrary.ru. – Режим доступа: по подписке;

4 Национальная электронная библиотека (НЭБ) : информационная система / ФГБУ «РГБ». – Москва, [2015 –]. – URL: http://rusneb.ru. – Режим доступа: по подписке;

5 Образовательная платформа ЮРАЙТ / ООО «Электронное издательство ЮРАЙТ». – Москва, [200 –]. – URL: https://urait.ru. – Режим доступа: для авторизир. пользователей;

6 Университетская библиотека онлайн : электронно-библиотечная система / ООО «Директ-Медиа». – Москва, [200 –]. – URL: https://biblioclub.ru. – Режим доступа: для авторизир. пользователей. – URL: http://www.biblioclub.ru;

7 Электронная библиотека // Научно-техническая библиотека СибГИУ : сайт. – Новокузнецк, [200 –]. – URL: http://library.sibsiu.ru/LibrELibraryFullText.asp. – Режим доступа: для авторизир. пользователей. – URL: https://library.sibsiu.ru/LibrELibraryFullText.asp;

8 Электронные периодические издания ИВИС : универсальная база данных / ООО «ИВИС». – Москва, [200 –]. – URL: http://eivis.ru. – Режим доступа: по подписке;

9 Электронный каталог : сайт / Научно-техническая библиотека СибГИУ. – Новокузнецк, [199 –]. – URL: http://libr.sibsiu.ru. – URL: https://libr.sibsiu.ru.

в) лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:

– 7-Zip;

– Adobe Acrobat Reader.

г) базы данных и информационно-справочные системы:

1 ГАРАНТ : справочно-правовая система / ООО «Правовой центр «Гарант». – Кемерово, [200 –]. – Режим доступа: компьютерная сеть Сиб. гос. индустр. ун-та.;

2 КонсультантПлюс : справочно-правовая система / ООО «Информационный центр АНВИК». – Новокузнецк, [199 –]. – Режим доступа: компьютерная сеть библиотеки Сиб. гос. индустр. ун-та.;

3 Техэксперт : информационно-справочная система / ООО «Группа компаний «Кодекс». – Кемерово, [200 –]. – Режим доступа: компьютерная сеть Сиб. гос. индустр. ун-та.

11 Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины

Материально-техническое обеспечение учебной дисциплины включает учебные аудитории, оснащенные оборудованием, компьютерной техникой, и техническими средствами обучения, в том числе:
- учебную аудиторию для проведения занятий лекционного типа, оборудованную учебной доской, экраном и мультимедийным проектором;
- учебную аудиторию для проведения занятий семинарского типа (практических занятий);
- учебную аудиторию (помещения) для групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации;
- помещения для самостоятельной работы, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду, научно-техническую библиотеку СибГИУ.

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки (специальности) 38.03.02 «Менеджмент».

Составитель(и):

заведующий кафедрой Иванова Елена Владимировна (кафедра менеджмента и отраслевой экономики).

Рабочая программа дисциплины рассмотрена и утверждена на заседании кафедры.

Приложение

Аннотация
рабочей программы дисциплины «Риск-менеджмент»

по направлению подготовки (специальности)
38.03.02 «Менеджмент»
(направленность (профиль): «Менеджмент организации»)
форма обучения – Очно-заочная форма

1 Цели и задачи освоения учебной дисциплины

Целями учебной дисциплины являются:

– формирование у обучающихся устойчивых фундаментальных знаний и развитие практических навыков в области риск-менеджмента.

Задачами учебной дисциплины являются:

– раскрыть содержание деятельности по управлению рисками;
– определить цели, задачи и функции риск-менеджмента;
– описать особенности принятия управленческих решений в области управления рисками;
– дать характеристику научного инструментария и методологии, используемых в процессе управления рисками;
– ознакомить с особенностями формирования и функционирования службы риск-менеджмента в организации;
– научить обучающихся понимать причины возникновения рисковых ситуаций, закономерности их развития, выбирать эффективные методы противодействия этому развитию, выполнять оценку степени риска и неопределенности при принятии решений в различных сферах хозяйственной деятельности организации, разрабатывать программу управления рисками.

2 Место учебной дисциплины в структуре ООП по направлению подготовки (специальности)

Учебная дисциплина относится к учебным дисциплинам части, формируемой участниками образовательных отношений **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 38.03.02 «Менеджмент».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

– Основы интеллектуального труда и управление временем;
– Основы планирования профессиональной деятельности;
– Управление операциями на фондовом рынке;
– Операционный менеджмент;
– Управление инвестициями;
– Безопасность жизнедеятельности;

– Основы проектной деятельности;
– Экономическая теория;
– Экономика организации;
– Менеджмент;
– Управление социальным развитием организации;
– Математические методы в экономике;
– Финансовое планирование;
– Налоговый менеджмент;
– Банковский менеджмент;
– Проектная деятельность 1;
– Проектная деятельность 2;
– Противодействие коррупции.

Учебная дисциплина дополняет знания, умения и навыки, получаемые по одновременно изучаемым и последующим дисциплинам:

– Антикризисное управление;
– Бизнес планирование;
– Преддипломная практика;
– Выполнение и защита выпускной квалификационной работы.

3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– Профессиональные компетенции

Наименование категории (группы) ПК	Код и наименование ПК	Код и наименование индикатора достижения ПК	Планируемые результаты обучения
	ПК-4: Способен разрабатывать мероприятия по воздействию на отдельные виды рисков и проводить их экономическую оценку	ПК-4.1 Выбирает методы оценки рисков	– знать: методы оценки рисков. – уметь: сравнивать методы оценки рисков. – владеть: навыками выделения преимуществ и недостатков методов оценки рисков; навыками отбора подходящих методов оценки рисков.
		ПК-4.2 Проводит анализ и оценку рисков	– знать: методологию и нормативно-правовых основы идентификации и оценки рисков . – уметь: осуществлять расчеты, прогнозировать уровень риска при принятии решений об

			инвестировании и финансировании. – владеть: навыками анализа рисков реальных и финансовых инвестиций.
		ПК-4.3 Разрабатывает мероприятия по управлению рисками	– знать: критерии, применяемые при выработке варианта управленческого решения по воздействию на риски . – уметь: предлагать решения по воздействию на отдельные виды рисков с учетом их результативности и экономической эффективности. – владеть: навыками выбора оптимального варианта управленческого решения в области риск-менеджмента.

– Универсальные компетенции

Наименование категории (группы) УК	Код и наименование УК	Код и наименование индикатора достижения УК	Планируемые результаты обучения
Системное и критическое мышление	УК-1: Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	УК-1.3 Анализирует предлагаемые варианты решения задачи, оценивает их достоинства и недостатки	– знать: законодательство Российской Федерации и отраслевые стандарты по управлению рисками, базовые положения международных стандартов по риск-менеджменту. – уметь: сравнивать различные варианты инвестирования с учетом риска, применять системный подход при решении задач риск-менеджмента. – владеть: навыками

			сравнения вариантов инвестирования.

4 Объем учебной дисциплины

Семестр / курс		*ИТОГО*	*9 семестр*
Форма промежуточной аттестации			*экзамен*
Трудоёмкость	*академ. час.*	***108***	*108*
	зачетных единиц	***3***	*3*
Лекции, *академ. час.*		***8***	*8*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Лабораторные работы, *академ. час.*		***0***	*0*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Практические занятия, *академ. час.*		***8***	*8*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Курсовая работа / проект, *академ. час.*		***0***	*0*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Консультации, *академ. час.*		***0***	*0*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Самостоятельная работа, *академ. час.*		***74***	*74*
в форме практической подготовки		***0***	*0*
Контроль, *академ. час.*		***18***	*18*
в форме практической подготовки		***0***	*0*

5 Краткое содержание учебной дисциплины

В структуре учебной дисциплины выделяются следующие основные разделы (темы):

Раздел 1 Теоретические основы управления рисками;

Тема 1.1 Аксиомы, законы и принципы риск менеджмента (Актуальность изучения управления рисками. Определение риск-менеджмента, ключевые составляющие понятия «риск-менеджмент». Аксиомы риск-менеджмента. Законы управления рисками: общие и специфические. Принципы управления рисками в системе принципов менеджмента.);

Тема 1.2 Понятие и классификация рисков (Риски окружающего мира. Риск и неопределенность: информационный и оценочный подходы к разграничению понятий. Объективное и субъективное понимание риска.

Основные характеристики рисков: экономическая природа, объективность проявления, вероятность возникновения, неопределенность последствий, ожидаемая неблагоприятность последствий, вариабельность уровня, субъективность оценки, наличие анализа, значимость.

Понятие экономического риска. Риски в производственной, финансовой и коммерческой деятельности.

Классификация рисков. Факторы и причины риска);

Тема 1.3 Процесс риск-менеджмента (Обмен информацией и консультирование с внешними и внутренними заинтересованными

сторонами по вопросам риск-менеджмента. Определение ситуации (контекста). Оценка риска (идентификация риска, анализ риска, оценивание риска). Воздействие на риск (выбор вариантов воздействия на риск, подготовка и реализация планов воздействия на ров). иск). Мониторинг и пересмотр (мониторинг и повторная оценка риска). Регистрация процесса риск-менеджмента (ведение документации по результатам реализации процесса риск-менеджмента));

Тема 1.4 Методы оценки риска (Основные методы и приемы оценки риска (краткий обзор, область применения, входные данные, процесс выполнения метода, выход-ные данные, преимущества и недостатки метода). Типы методов оценки рисков (методы наблюдения, вспомогательные методы, функ-циональный анализ, статистические методы). Выбор метода оценки риска для конкретной ситуации. Применимость метода оценки риска. Факторы, влияющие на выбор метода оценки риска);

Раздел 2 2 Управление рисками как сфера профессионального менеджмента;

Тема 2.1 Общая характеристика системы управления рисками (Логика построения системы управления рисками, основные эле-менты этой системы. Свойства системы управления рисками: систем-ный характер управления рисками, сложная структура системы управления рисками, результативность системы управления рисками.
Основные принципы построения системы управления рисками);

Тема 2.2 Управление риском как часть общего менеджмента организации (Управление риском и стратегия организации. Взаимосвязь развития организации и соответствующих вариантов управления рисками.
Управление риском и организационная структура управления компанией.
Аутсорсинг управления риском);

Тема 2.3 Цели и задачи системы управления рисками (Цели системы управления рисками: главные и вспомогательные. Требования к целям управления рисками. Задачи системы управления рисками. Взаимосвязь основных групп задач системы управления рисками);

Тема 2.4 Ограничения системы управления рисками (Внешние ограничения системы управления рисками: законодательные, конъюнктурные и связанные с обязательствами фирмы.
Внутренние ограничения системы управления рисками: институциональные, бюджетные, организационные);

Тема 2.5 Организация управления рисками (Понятие портфеля рисков. Специфика управления портфелем рисков. Два уровня исследования рисков. Управление рисками как динамический процесс. Организационная структура управления рисками. Функции отдела по управлению рисками и риск-менеджера организации. Основные документы, регламентирующие управление рисками на предприятии:

«Положение по управлению рисками» и «Руководство по управлению рисками». Их содержание и особенности составления);

Раздел 3 Анализ, оценка и прогнозирование рисков;

Тема 3.1 Оценка рисков финансовых активов (Риск и доходность отдельных активов. Риск и доходность портфеля активов.);

Тема 3.2 Учет риска при анализе инвестиционных проектов (Метод корректировки нормы дисконта. Метод корректировки параметров проекта. Метод достоверных эквивалентов. Анализ чувствительности критериев эффективности проекта. Метод сценариев. Анализ вероятностных распределений потоков платежей. Анализ риска проекта с использованием «дерева решений» (или метода предпочтительного состояния). Имитационное моделирование инвестиционных рисков).

6 Составитель(и):

заведующий кафедрой Иванова Елена Владимировна (кафедра менеджмента и отраслевой экономики).