

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

Управление стратегическими рисками

38.04.02 «Менеджмент»
(направленность (профиль): «Производственный менеджмент»)

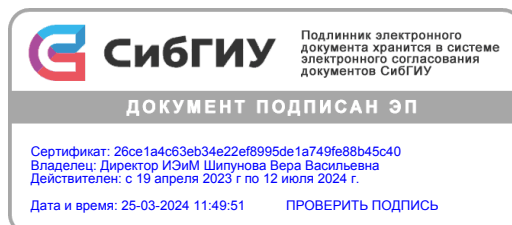
Квалификация выпускника
Магистр

Форма обучения
Очно-заочная форма

Срок обучения: 2 года 3 месяца

Год начала подготовки 2024

Новокузнецк
2024



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 стратегическими 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 рискованных 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 обязательной части **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 38.04.02 «Менеджмент».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

- Разработка и реализация проектов 2;
- Инвестиционный менеджмент;
- Разработка и реализация проектов 1;
- Устойчивое развитие и стратегия компании;
- Современный стратегический анализ;
- Современные модели бизнеса и стратегии управления;
- Методы исследований в менеджменте;
- Управление корпоративными финансами.

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

- Корпоративная социальная ответственность;
- Бизнес-планирование: стратегический аспект;
- Управление корпоративными финансами;
- Преддипломная практика;
- Научно-исследовательская работа;

- Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы.

3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– Общепрофессиональные компетенции

Наименование категории (группы) ОПК	Код и наименование ОПК	Код и наименование индикатора достижения ОПК	Планируемые результаты обучения
	ОПК-2: Способен применять современные техники и методики сбора данных, продвинутые методы их обработки и анализа, в том числе использовать интеллектуальные информационно-аналитические системы, при решении управленческих и исследовательских задач	ОПК-2.1 Применяет современные техники и методики поиска и сбора данных, необходимых для решения управленческих и исследовательских задач	<ul style="list-style-type: none"> – знать: современные техники и методики поиска и сбора данных, необходимых для оценки и прогнозирования рисков, нормативно-правовых документов, регламентирующих управление стратегическими рисками. – уметь: находить нужную информацию для управления стратегическими рисками с использованием современной техники.
		ОПК-2.2 Выполняет обработку и анализ данных с использованием продвинутых методов, в том числе интеллектуальных информационно-аналитических систем, при решении управленческих и исследовательских задач	<ul style="list-style-type: none"> – знать: сущность, особенности, область применения различных методов оценки и прогнозирования стратегических рисков. – уметь: отбирать подходящие методы оценки рисков, проводить оценку отдельных видов рисков с целью эффективного управления ими с использованием интеллектуальных информационно-

			аналитических систем, строить карту рисков.
		ОПК-2.3 Формулирует выводы по результатам анализа данных и прогнозирует показатели для решения управленческих и исследовательских задач	– знать: экономический смысл показателей, используемых для оценки и прогнозирования рисков. – уметь: оценивать уровень риска и интерпретировать полученные значения показателей риска.
	ОПК-3: Способен самостоятельно принимать обоснованные организационно-управленческие решения, оценивать их операционную и организационную эффективность, социальную значимость, обеспечивать их реализацию в условиях сложной (в том числе кросс-культурной) и динамичной среды	ОПК-3.1 Принимает обоснованные организационно-управленческие решения в условиях сложной (в том числе кросс-культурной) и динамичной среды	– знать: методы минимизации и предотвращения стратегических рисков, критерии выбора оптимальных решений на основе теории игр. – уметь: формулировать превентивные мероприятия и разрабатывать план мероприятий по снижению стратегических рисков.
ОПК-3.2 Самостоятельно определяет условия реализации организационно-управленческих решений в сложной (в том числе кросс-культурной) и динамичной среде		– знать: нормативно-правовые основы управления стратегическими рисками, концепцию и экономический механизм управления стратегическими рисками. – уметь: использовать сценарный подход для прогнозирования развития рисков ситуации и определять условия сценариев.	
ОПК-3.3 Оценивает последствия альтернативных вариантов		– знать: возможные социально-экономических последствия	

		организационно-управленческих решений	управления стратегическими рисками. – уметь: прогнозировать последствия решений по снижению стратегических рисков.
--	--	---------------------------------------	---

– 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 критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	УК-1.3 Рассматривает различные варианты решения проблемной ситуации на основе системного подхода, оценивает их преимущества и риски	– знать: сущность, принципы системного подхода, методологию принятия управленческих решений при управлении стратегическими рисками. – уметь: выявлять варианты решения проблемной ситуации на основе системного подхода.

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	6 семестр
Форма промежуточной аттестации			зачет
Трудоёмкость	<i>академ. час.</i>	108	108
	<i>зачетных единиц</i>	3	3
Лекции, <i>академ. час.</i>		4	4

в форме практической подготовки	0	0
Лабораторные работы, <i>академ. час.</i>	0	0
в форме практической подготовки	0	0
Практические занятия, <i>академ. час.</i>	6	6
в форме практической подготовки	0	0
Курсовая работа / проект, <i>академ. час.</i>	0	0
в форме практической подготовки	0	0
Консультации, <i>академ. час.</i>	0	0
в форме практической подготовки	0	0
Самостоятельная работа, <i>академ. час.</i>	89	89
в форме практической подготовки	0	0
Контроль, <i>академ. час.</i>	9	9
в форме практической подготовки	0	0

Содержание учебной дисциплины

Раздел 1 Методологические основы управления стратегическими рисками;

Тема 1.1 Стратегические риски в системе риск-менеджмента компании (Место стратегических рисков системе риск-менеджмента компании. Особенности стратегических рисков. Нормативно-правовые основы управления стратегическими рисками. Цели и задачи управления стратегическими рисками);

Тема 1.2 Идентификация стратегических рисков (Природа формирования стратегических рисков. Подходы к идентификации стратегических рисков. Риски, связанные с выбором стратегии. Риски, связанные с реализацией стратегии.);

Тема 1.3 Организация управления стратегическими рисками (Концепция управления стратегическими рисками. Экономический механизм управления стратегическими рисками. Функционирование модели. Система контроля уровня стратегических рисков.);

Тема 1.4 Разработка противорисковых мероприятий при управлении стратегическими рисками (Способы противодействия стратегическим рискам. Оценка управляющих последствий противорисковых мероприятий. Расходы на недопущение риска);

Раздел 2 Анализ, оценка и прогнозирование рисков;

Тема 2.1 Оценка стратегических рисков (Метод корректировки нормы дисконта. Метод корректировки параметров бизнес-модели. Метод достоверных эквивалентов. Анализ чувствительности критериев стоимости бизнес-модели. Метод сценариев. Анализ вероятностных распределений потоков платежей. Анализ стратегического риска с использованием «дерева решений» (или метода предпочтительно-го состояния). Имитационное моделирование стратегических рисков);

Тема 2.2 Оценка последствий решений при управлении стратегическими рисками (Оценка целевой эффективности стратегии компании. Статистическое моделирование последствий управления

стратегическими рисками. Критерии Сэвиджа и Вальда. Критерий Гурвица).

5 Перечень тем лекций

№ раздела / темы дисциплины	Темы лекций	Трудоемкость, <i>академ. час</i>	
		всего	в форме практической подготовки
Тема 1.1.	Стратегические риски в системе риск-менеджмента компании	1	
Тема 1.2.	Идентификация стратегических рисков	1	
Тема 1.3.	Организация управления стратегическими рисками	1	
Тема 1.4.	Разработка противорисковых мероприятий при управлении стратегическими рисками	1	
Итого:		4	0

6 Перечень тем практических занятий (семинаров)

№ раздела / темы дисциплины	Темы практических занятий (семинаров)	Трудоемкость, <i>академ. час</i>	
		всего	в форме практической подготовки
Раздел 2; Тема 2.1.	Оценка и прогнозирование уровня стратегических рисков	3	
Тема 2.2.	Оценка последствий противорисковых мероприятий при управлении стратегическими рисками	3	
Итого:		6	0

7 Перечень тем лабораторных работ

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

8 Перечень тем курсовых работ (проектов)

№ раздела / темы	Темы курсовых работ	Трудоемкость, <i>академ. час</i>
------------------	---------------------	----------------------------------

дисциплины	(проектов)	всего	в форме практической подготовки
	<i>Отсутствуют</i>		
Итого:		0	0

9 Виды самостоятельной работы

№ раздела / темы дисциплины	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость, <i>академ. час</i>	
		всего	в форме практической подготовки
Раздел 1.	1. Выполнение домашнего задания; 2. Изучение лекционного материала; 3. Изучение теоретического материала.	40	
Раздел 2.	1. Выполнение домашнего задания; 2. Изучение теоретического материала; 3. Оформление отчета о практической работе; 4. Подготовка к практическому занятию.	49	
<i>Контроль</i>	<i>Подготовка к зачёту</i>	9	
Итого:		98	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 : Издательство Юрайт, 2024. — 485 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-12206-0. — URL: <https://urait.ru/bcode/536576> (дата обращения: 24.03.2024);

2 Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 365 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-3502-8. — URL: <https://urait.ru/bcode/536005> (дата обращения: 24.03.2024);

3 Шкурко, В. Е. Управление рисками проекта : учебник для вузов / В. Е. Шкурко ; под научной редакцией А. В. Гребенкина. — 2-е изд. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 163 с. — (Высшее образование).

— ISBN 978-5-534-16836-5. – URL: <https://urait.ru/bcode/540420> (дата обращения: 24.03.2024);

4 Никонов, В. Управление рисками : Как больше зарабатывать и меньше терять / В. Никонов. - Москва : Альпина Паблишер, 2016. - 285 с. - ISBN 978-5-9614-1013-6. – URL: <https://www.studentlibrary.ru/book/ISBN9785961410136.html> (дата обращения: 24.03.2024);

5 Чертыковцев, В. К. Математическая теория рисков в социально-экономической сфере : учебник для вузов / В. К. Чертыковцев. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 104 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-14457-4. – URL: <https://urait.ru/bcode/544323> (дата обращения: 24.03.2024);

6 Жуковский, В. И. Оценка рисков и многошаговые позиционные конфликты : учебное пособие для вузов / В. И. Жуковский, М. Е. Салуквадзе. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 305 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08782-6. – URL: <https://urait.ru/bcode/540722> (дата обращения: 24.03.2024);

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: 24.03.2024).

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

5 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>;

6 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>;

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

8 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;
- Astra Linux Special Edition;
- Kaspersky Endpoint Security;
- Бизнес-аналитик.

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);
- 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;
- учебную аудиторию (помещения) для групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки (специальности) 38.04.02 «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 «Управление стратегическими рисками»

по направлению подготовки (специальности)

38.04.02 «Менеджмент»

(направленность (профиль): «Производственный менеджмент»)
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 стратегическими 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 рискованных 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 обязательной части **Блока 1 «Дисциплины (модули)»** ООП по направлению подготовки (специальности) 38.04.02 «Менеджмент».

Учебная дисциплина базируется на предварительном усвоении обучающимися учебных дисциплин:

- Разработка и реализация проектов 2;
- Инвестиционный менеджмент;
- Разработка и реализация проектов 1;
- Устойчивое развитие и стратегия компании;
- Современный стратегический анализ;
- Современные модели бизнеса и стратегии управления;

- Методы исследований в менеджменте;
- Управление корпоративными финансами.

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

- Корпоративная социальная ответственность;
- Бизнес-планирование: стратегический аспект;
- Управление корпоративными финансами;
- Преддипломная практика;
- Научно-исследовательская работа;
- Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы.

3 Планируемые результаты обучения по учебной дисциплине

Процесс изучения учебной дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– Общепрофессиональные компетенции

Наименование категории (группы) ОПК	Код и наименование ОПК	Код и наименование индикатора достижения ОПК	Планируемые результаты обучения
	ОПК-2: Способен применять современные техники и методики сбора данных, продвинутые методы их обработки и анализа, в том числе использовать интеллектуальные информационно-аналитические системы, при решении управленческих и исследовательских задач	ОПК-2.1 Применяет современные техники и методики поиска и сбора данных, необходимых для решения управленческих и исследовательских задач	<ul style="list-style-type: none"> – знать: современные техники и методики поиска и сбора данных, необходимых для оценки и прогнозирования рисков, нормативно-правовых документов, регламентирующих управление стратегическими рисками. – уметь: находить нужную информацию для управления стратегическими рисками с использованием современной техники.
		ОПК-2.2 Выполняет обработку и анализ данных с использованием продвинутых методов, в том числе интеллектуальных информационно-аналитических систем, при решении	<ul style="list-style-type: none"> – знать: сущность, особенности, область применения различных методов оценки и прогнозирования стратегических рисков. – уметь: отбирать подходящие методы

		<p>управленческих и исследовательских задач</p>	<p>оценки рисков, проводить оценку отдельных видов рисков с целью эффективного управления ими с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем, строить карту рисков.</p>
		<p>ОПК-2.3 Формулирует выводы по результатам анализа данных и прогнозирует показатели для решения управленческих и исследовательских задач</p>	<p>– знать: экономический смысл показателей, используемых для оценки и прогнозирования рисков. – уметь: оценивать уровень риска и интерпретировать полученные значения показателей риска.</p>
	<p>ОПК-3: Способен самостоятельно принимать обоснованные организационно-управленческие решения, оценивать их операционную и организационную эффективность, социальную значимость, обеспечивать их реализацию в условиях сложной (в том числе кросс-культурной) и динамичной среды</p>	<p>ОПК-3.1 Принимает обоснованные организационно-управленческие решения в условиях сложной (в том числе кросс-культурной) и динамичной среды</p>	<p>– знать: методы минимизации и предотвращения стратегических рисков, критерии выбора оптимальных решений на основе теории игр. – уметь: формулировать превентивные мероприятия и разрабатывать план мероприятий по снижению стратегических рисков.</p>
		<p>ОПК-3.2 Самостоятельно определяет условия реализации организационно-управленческих решений в сложной (в том числе кросс-культурной) и динамичной среде</p>	<p>– знать: нормативно-правовые основы управления стратегическими рисками, концепцию и экономический механизм управления стратегическими рисками. – уметь: использовать сценарный подход</p>

			для прогнозирования развития рисков ситуации и определять условия сценариев.
		ОПК-3.3 Оценивает последствия альтернативных вариантов организационно-управленческих решений	– знать: возможные социально-экономических последствия управления стратегическими рисками. – уметь: прогнозировать последствия решений по снижению стратегических рисков.

– 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 критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	УК-1.3 Рассматривает различные варианты решения проблемной ситуации на основе системного подхода, оценивает их преимущества и риски	– знать: сущность, принципы системного подхода, методологию принятия управленческих решений при управлении стратегическими рисками. – уметь: выявлять варианты решения проблемной ситуации на основе системного подхода.

4 Объем учебной дисциплины

Семестр / курс	ИТОГО		6 семестр
Форма промежуточной аттестации			зачет
Трудоёмкость	академ. час.	108	108
	зачетных единиц	3	3
Лекции, академ. час.		4	4
в форме практической подготовки		0	0
Лабораторные работы, академ. час.		0	0
в форме практической подготовки		0	0
Практические занятия, академ. час.		6	6
в форме практической подготовки		0	0
Курсовая работа / проект, академ. час.		0	0

в форме практической подготовки	0	0
Консультации, <i>академ. час.</i>	0	0
в форме практической подготовки	0	0
Самостоятельная работа, <i>академ. час.</i>	89	89
в форме практической подготовки	0	0
Контроль, <i>академ. час.</i>	9	9
в форме практической подготовки	0	0

5 Краткое содержание учебной дисциплины

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

Раздел 1 Методологические основы управления стратегическими рисками;

Тема 1.1 Стратегические риски в системе риск-менеджмента компании (Место стратегических рисков системе риск-менеджмента компании. Особенности стратегических рисков. Нормативно-правовые основы управления стратегическими рисками. Цели и задачи управления стратегическими рисками);

Тема 1.2 Идентификация стратегических рисков (Природа формирования стратегических рисков. Подходы к идентификации стратегических рисков. Риски, связанные с выбором стратегии. Риски, связанные с реализацией стратегии.);

Тема 1.3 Организация управления стратегическими рисками (Концепция управления стратегическими рисками. Экономический механизм управления стратегическими рисками. Функционирование модели. Система контроля уровня стратегических рисков.);

Тема 1.4 Разработка противорисковых мероприятий при управлении стратегическими рисками (Способы противодействия стратегическим рискам. Оценка управляющих последствий противорисковых мероприятий. Расходы на недопущение риска);

Раздел 2 Анализ, оценка и прогнозирование рисков;

Тема 2.1 Оценка стратегических рисков (Метод корректировки нормы дисконта. Метод корректировки параметров бизнес-модели. Метод достоверных эквивалентов. Анализ чувствительности критериев стоимости бизнес-модели. Метод сценариев. Анализ вероятностных распределений потоков платежей. Анализ стратегического риска с использованием «дерева решений» (или метода предпочтительно-го состояния). Имитационное моделирование стратегических рисков);

Тема 2.2 Оценка последствий решений при управлении стратегическими рисками (Оценка целевой эффективности стратегии компании. Статистическое моделирование последствий управления стратегическими рисками. Критерии Сэвиджа и Вальда. Критерий Гурвица).

6 Составитель(и):

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