

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

1. Цель учебной дисциплины (модуля) – формирование у слушателей системы теоретических знаний и практических навыков по управлению рисками в организации.

2. Требования к уровню освоения учебной дисциплины (модуля).

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения
<p>ПК-1 Способен выбирать методические подходы к оценке уровня рисков и экономической безопасности в разрезе отдельных видов</p>	<p>ИПК-1.1 Демонстрирует умение применять различные методы и технологии анализа и моделирования рисков ИПК-1.2 Владеет информацией об организации, рынке, законодательстве, социальном, культурном и политическом окружении организации, а также о стратегии ее развития и операционных процессах, включая информацию об угрозах и возможностях достижения поставленных целей ИПК-1.3 Владеет методами анализа рисков, в том числе вероятности и объема экономических потерь в разрезе отдельных видов риска на основе установленных методических принципов и подходов</p>	<p>знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> – методические подходы к оценке уровня рисков и экономической безопасности организации; – задачи, принципы и цели формирования стандартов стратегического регулирования процесса управления рисками; – сущность и элементы стратегического менеджмента и маркетинга. <p>уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> – применять различные методы и технологии анализа и моделирования рисков; – использовать информацию об организации, рынке, законодательстве, социальном, культурном и политическом окружении организации, включая информацию об угрозах и возможностях достижения поставленных целей;
<p>ПК-2 Способен формировать методические основы системы управления рисками в рамках отдельных бизнес-процессов и функциональных направлений</p>	<p>ИПК-2.1 Демонстрирует умение организовывать процесс управления рисками в организации ИПК-2.2 Демонстрирует умение рассчитывать, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками ИПК-2.3 Владеет понятиями, методами и инструментами классификации рисков организации</p>	<ul style="list-style-type: none"> – оценивать ресурсные затраты, необходимые для обеспечения эффективного внедрения и функционирования процесса управления.
<p>ПК-4 Способен формулировать задачи, принципы и цели стратегического регулирования процесса управления рисками</p>	<p>ИПК-4.1 Демонстрирует умение оценивать ресурсные затраты, необходимые для обеспечения эффективного внедрения и функционирования процесса управления рисками ИПК-4.2 Владеет знаниями сущности и элементов стратегического менеджмента и маркетинга ИПК-4.3 Демонстрирует умение определять приоритеты и текущие цели риск-менеджмента для всех подразделений организации на основе</p>	<p>владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> – методами анализа и оценки рисков, в том числе вероятности и объема экономических потерь; – навыками определения приоритетов и текущих целей риск-менеджмента для всех подразделений организации на основе бизнес-стратегии;

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Планируемые результаты обучения
	бизнес-стратегии и стратегии управления рисками	– методами выбора антирисковых мероприятий.
ПК-6 Способен определить аналитические процедуры и методы анализа и оценки рисков	<p>ИПК-6.1 Демонстрирует умение определять эффективные методы анализа и оценки рисков с позиции их идентификации по функциональным областям</p> <p>ИПК-6.2 Демонстрирует умение использовать программное обеспечение для работы с информацией (текстовые и аналитические приложения, приложения для визуализации данных) на уровне опытного пользователя</p> <p>ИПК-6.3 Владеет знаниями при определении методов, техники, технологии, программных средства и информационных баз идентификации различных видов риска</p>	
ПК-7 Способен идентифицировать, анализировать и оценивать наиболее критичные риски организации	<p>ИПК-7.1 Демонстрирует умение осуществлять расчеты, прогнозировать, тестировать и верифицировать методики управления рисками с учетом отраслевой специфики</p> <p>ИПК-7.2 Владеет знаниями анализа процессов управления в чрезвычайных и кризисных ситуациях, а также управления непрерывностью бизнеса</p> <p>ИПК-7.3 Владеет знаниями современных информационных систем и технологий управления рисками</p>	

3. Содержание учебной дисциплины (модуля).

Раздел 1. Основные аспекты и тенденции риск-менеджмента

Основные определения и понятия риск-менеджмента. Процессы управления риском. Основные элементы и этапы управления риском. Манипулирование риском. Глобальные задачи в области управления рисками: применение риск менеджмента; управление рисками по их типам; точность оценок рисков. Функции риск-менеджмента. Организация риск-менеджмента. Правила риск-менеджмента. Расчет коэффициента риска. Функции отдела рискованных вложений капитала. Информационное обеспечение функционирования риск-менеджмента.

Раздел 2. Классификация рисков

Классификация рисков по их функциональной направленности. Чистые и спекулятивные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Риски зависимости от основной причины их возникновения. Риски, связанные с покупательной способностью денег. Инвестиционные риски. Производственный риск. Коммерческий риск. Финансовый риск. Селективные риски. Риск банкротства. Биржевые риски. Транспортный риск – четыре группы по степени ответственности (E, F, C, D.). Валютный риск. Региональный риск. Отраслевой риск. Инновационный риск. Риски неисполнения хозяйственных договоров. Риски изменения рыночной

конъюнктуры и усиления конкуренции. Риски возникновения непредвиденных расходов и снижения доходов. Риски потери имущества бизнеса. Риск невостребованности продукции. Форс-мажорные риски.

Раздел 3. Анализ и оценка степени риска

Идентификация и концептуальные направления анализа рисков. Качественный анализ. Количественной оценки. Этапы идентификации и анализа рисков. Полезность информации. Эффективность управления риском. Доступность информации. Достоверность информации. Общие группы источников информации при анализе конкретных рисков. Информационная система, обслуживающая процесс управления рисками. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска. Рисковый капитал. Система неопределенностей. Полная неопределенность. Полная определенность. Частичная неопределенность.

Раздел 4. Управление рисками, как система менеджмента

Процесс управления рисками в организации и его этапы. Анализ альтернатив управления риском. Классификация методов управления рисками. Выбор методов управления риском. Методы управления рисками (четыре группы). Методы уклонения от риска. Ограничения применения методов управления рисками.

Раздел 5. Риск-менеджмент в инвестиционной стратегии.

Анализ риска в инвестиционной программе с привлечением кредитов. Выбор оптимального инвестиционного проекта. График вероятностей периодов погашения кредита. Суммарные значения вероятностей периодов погашения кредита. Двухуровневые вероятности окупаемости программ инвестирования. Совокупные вероятности обобщенных периодов окупаемости в программах инвестирования. Рейтинговые значения двухуровневых вероятностей окупаемости инвестиций. Основные понятия и принципы оценки эффективности инвестиций.

4. Учебно-методическое обеспечение учебной дисциплины (модуля).

4.1. Литература по учебной дисциплине (модулю):

1. Шапкин, А. С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций : учебник для вузов / А. С. Шапкин, В. А. Шапкин. - 3-е изд. – Москва : Дашков и К, 2008 – 879 с.
2. Липсиц, И. В. Экономический анализ реальных инвестици : учебное пособие / И. В. Липсиц, В. В. Коссов. - 2-е изд, перераб. и доп. – Москва : Экономистъ, 2004. – 345, [7] с.

4.2. Интернет-ресурсы учебной дисциплины (модуля):

1. Айбукс : электронно-библиотечная система. - URL: <http://ibooks.ru>
2. Электронная библиотека НБ ТГПУ. - URL: <https://libserv.tspu.edu.ru>
3. Лань : электронно-библиотечная система. - URL: <http://e.lanbook.com>
4. IPR SMART : электронно-библиотечная система. - URL: <http://iprbookshop.ru>

5. Оценочные и методические материалы для проведения промежуточной аттестации слушателей по учебной дисциплине (модулю).

5. 1. Вопросы для подготовки к промежуточной аттестации.

1. Понятие и содержание риск-менеджмента.
2. Основные элементы и этапы управления рисками.
3. Функции и правила риск-менеджмента.
4. Сущность и расчет коэффициента риска.

5. Информационное обеспечение риск-менеджмента.
6. Понятие и значение риска в предпринимательской деятельности.
7. Взаимосвязь между риском и доходностью.
8. Организация и функционирование отдела рискованного вложения капитала.
9. Процесс управления рисками.
10. Основные проблемы риск-менеджмента.
11. Чистые и спекулятивные риски. Основные отличия и примеры.
12. Коммерческие риски.
13. Транспортные риски.
14. Финансовые риски.
15. Форс-мажорные риски.
16. Предпринимательские риски.
17. Биржевые риски.
18. Риск банкротства.
19. Направления классификации рисков.
20. Инновационные риски.
21. Экспертные, математические и статистические методы оценки риска.
22. Критерии оценки риска и основные показатели.
23. Понятие и приемы визуализации рисков.
24. Концепция рискованной стоимости.
25. Расчетные методы оценки риска.
26. Использование закона нормального распределения в риск менеджменте.
27. Использование стратегических (математических) игр в риск менеджменте.
28. Применение теории полезности в оценке рисков.
29. Количественные и экспертные методы оценки риска.
30. Статистические показатели оценки степени риска.
31. Классификация методов управления рисками.
32. Методы управления рисками (четыре группы).
33. Методы уклонения от риска.
34. Риск-менеджмент в инвестиционной стратегии.

Рабочая программа учебной дисциплины составлена:
Филонов Н.Г., д.ф.-м.н., профессор кафедры менеджмента.