

Аннотация к рабочей программе дисциплины «Управление рисками»

Учебный курс «Управление рисками» предназначен для студентов направления подготовки 38.03.01 Экономика.

Дисциплина «Управление рисками» включена в состав вариативной части блока «Дисциплины (модули)».

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3/3 зачетные единицы, 108/1078 часа. Учебным планом предусмотрены лекционные занятия (18/6 часов), практические работы (36/10 часов, в том числе МАО 18/10 часов), самостоятельная работа студентов (54/92 часа, в том числе на подготовку к зачету -/4 часа). Дисциплина реализуется на 3/3 курсе в 6 семестре.

Дисциплина «Управление рисками» основывается на знаниях, умениях и навыках, полученных в результате изучения дисциплин «Математика», «Эконометрика», «Основы менеджмента», «Теория вероятности и математическая статистика» и позволяет подготовить студентов к освоению ряда таких дисциплин, как «Рынок ценных бумаг», «Финансовые риски и страхование», а также к прохождению производственной практики.

Содержание дисциплины состоит из пяти разделов и охватывает следующий круг вопросов:

1. Понятие, сущность и содержание риск-менеджмента. Причины возникновения рисков, Функции рисков. Классификация рисков. Цель и задачи риск-менеджмента.

2. Анализ рисков. Качественный анализ. Зоны риска. Коэффициент риска. Кривая риска. Общая характеристика методов количественного анализа рисков. Метод аналогий. Метод анализа чувствительности. Анализ сценариев. Метод статистических испытаний (Монте-Карло), Экспертные методы.

3. Основы теории принятия рискованных решений. Вероятностные методы, использующие статистический анализ данных. Методы теории игр. Метод дерева решений.

4. Методы уменьшения риска. Управление операционными рисками. Управление кредитными рисками. Объединение и группирование рисков. Диверсификация. Распределение рисков.

5. Система управления рисками. Стандарты построения системы управления рисками: COSO, FERMA, ИСО/МЭК.

Цель – получение студентами теоретических знаний в области анализа рисков, принятия рискованных решений, применения методов уменьшения и управления рисками, а также разработки систем управления рисками на предприятии в соответствии с существующими стандартами.

Задачи:

- приобрести знания по организации процесса анализа рисков;
- освоить подходы и формальные методы разработки управленческих решений в условиях неопределенности и риска;
- получить знания в области разработки и реализации систем мониторинга и управления рисками.

В результате изучения данной дисциплины у обучающихся формируются следующие профессиональные компетенции (элементы компетенций):

Код и формулировка компетенции	Этапы формирования компетенции	
ПК-2 способность на основе типовых методик и действующей нормативно-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.	Знает	типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.
	Умеет	использовать на практике типовые методики и действующую нормативно-правовую базу расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.
	Владеет	типовыми методиками и действующей нормативно-правовой базой расчета социально-экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов.
ПК – 11 способность	Знает	методы оценки вариантов управленческих

критически оценить предлагаемые варианты управленческих решений, разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий		решений в условиях неопределенности и риска.
	Умеет	разрабатывать предложения по совершенствованию управленческих решений с учетом критериев социально – экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий
	Владеет	навыками самостоятельной работы, самоорганизации и организации выполнения поручений; навыками принятия управленческих решений; навыками аргументированного обоснования результатов работы предприятия

Для формирования вышеуказанных компетенций в рамках дисциплины «управление рисками» применяются следующие методы активного / интерактивного обучения: метод ситуационного анализа (ситуационные задачи), дискуссия.