

Аннотация к рабочей программе дисциплины Risk Management (Риск менеджмент)

Учебный курс «Risk Management (Риск менеджмент)» предназначен для студентов направления подготовки 38.04.02 Менеджмент, магистерская программа «International Business and Project Management / Международный бизнес и управление проектами (на английском языке)».

Дисциплина «Risk Management (Риск менеджмент)» включена в состав дисциплин по выбору вариативной части блока «Дисциплины (модули)».

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы, 108 часа. Учебным планом предусмотрены аудиторные лекционные занятия (18 часов), практические занятия (18 часов, в том числе МАО 12 часов), самостоятельная работа студентов (27 часов), в том числе на подготовку к экзамену 45 часов. Дисциплина реализуется на 1 курсе в 1 семестре.

Дисциплина «Risk Management (Риск менеджмент)» основывается на знаниях дисциплины «Экономика и управление: адаптационный курс», «Стратегический менеджмент», «Теория международных отношений», «Управление проектами», «Теория организации и организационное поведение», «Управленческая экономика», «Маркетинговое управление», «Менеджмент качества при создании инновационных продуктов», «Венчурные инвестиции и финансовые модели», «Предпринимательство» и позволяет подготовить студента к освоению ряда таких дисциплин, как «Эконометрика», «Ведение бизнеса в Азии», «Операционный менеджмент и эффективность бизнеса», «Бизнес-планирование»; к прохождению учебной и производственной практик.

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

1. Понятие, сущность и содержание риск менеджмента: понятие риска. Функции риска (инновационная функция, регулирующая функция, конструктивность и деструктивность риска, защитная функция, аналитическая функция). Источники рисков. Условия и факторы рисков и их

классификация. Чистые и спекулятивные риски. Природные, экологические, политические, транспортные, производственные, финансовые, инфляционные, системные, селективные риски, риск ликвидности, кредитные риски, региональный и отраслевой риски, риск предприятия и инновационный риск. Понятие риск-менеджмента. Направления управления рисками. Критерий оценки эффективности риск-менеджмента.

2. Анализ рисков: понятие зоны риска. Допустимый риск. Критический риск. Катастрофический риск. Кривая риска. Общая характеристика методов количественного анализа рисков. Коэффициент риска. Метод аналогий, метод анализа чувствительности, метод анализа сценариев, метод статистических испытаний (Монте-Карло), экспертные методы.

3. Основы теории принятия рискованных решений: понятие риска решения и коэффициента вариации, их расчет. Основные положения вероятностного подхода. Принятие диверсифицированных решений. Дерево решений. Матрица платежей. Критерий Вальда. Оптимистический подход. Критерий Гурвица. Критерии Байеса-Лапласа и Лапласа. Матрица упущенной выгоды. Критерий упущенной выгоды Сэвиджа. Управление операционными рисками. Управление кредитными рисками. Объединение и группирование рисков. Диверсификация. Распределение рисков. Стандарты построения системы управления рисками: COSO, FERMA, ИСО/МЭК. Разработка системы управления организацией.

Цель – формирование у студентов представления о возможностях применения знаний, полученных из других курсов, на основе анализа практики и понимания реальностей, с которыми сталкивается российская высокотехнологическая компания при решении задач и принятии рискованных решений. 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:

- приобретение студентами знаний по организации процесса анализа рисков;
- освоение подходов и формальных методов разработки управленческих решений в условиях неопределенности и риска;
- получение знаний в области разработки и реализации систем мониторинга и управления рисками.

Для успешного изучения дисциплины «Риск менеджмент» у обучающихся должны быть сформированы следующие предварительные компетенции:

- способность творчески воспринимать и использовать достижения науки, техники в профессиональной сфере в соответствии потребностями регионального и мирового рынка труда;
- способность использовать современные методы и технологии (в том числе информационные) в профессиональной деятельности.
- готовность интегрироваться в научное, образовательное, экономическое, политическое и культурное пространство России и АТР;
- умение пользоваться нормативными документами в своей профессиональной деятельности, готовность к соблюдению действующего законодательства и требований нормативных документов;
- способность осуществлять сбор, хранение, обработку и оценку информации, необходимой для организации и управления профессиональной деятельностью (коммерческой, маркетинговой, рекламной, логистической, товароведной, и (или) торгово-технологической); применять основные методы и средства получения, хранения, переработки информации и работать с компьютером как со средством управления информацией;
- способность к логическому мышлению, анализу, систематизации, обобщению, критическому осмыслению информации, постановке исследовательских задач и выбору путей их решения.

В результате изучения данной дисциплины у обучающихся формируются следующие профессиональные компетенции:

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 – 10 способность 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	Знает	Методы оценки вариантов управленческих 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	Методиками оценки социально-экономических последствий решений, принятых в условиях неопределенности и риска.
ПК-8 способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения	знает	методы сбора и анализа исходных данных для расчета экономических и социально-экономических показателей;
	умеет	проводить расчеты экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов;
	владеет	методикой проведения анализа результатов расчетов экономических и социально-экономических показателей;
ПК-5 способность определения перспектив развития организации на основе оценки положения компании на рынке и тенденции влияния факторов внешней среды	Знает	Основы анализа внешней среды
	Умеет	Находить решения стандартных задач в профессиональной деятельности с учетом основ инновационного менеджмента
	Владеет	Способностью решать различные задачи профессиональной деятельности с учетом основных современных социально-экономических требований внешней среды; методами учета неопределенности и риска в проектах, а также методами оценки эффективности проекта

Для формирования вышеуказанных компетенций в рамках дисциплины «Risk Management (Риск менеджмент)» применяются следующие методы активного/ интерактивного обучения:

- практическое занятие - разбор конкретных ситуаций;
- семинар – дискуссия, с презентациями;
- кейсы.