

Аннотация к рабочей программе дисциплины «Практика управления экономическими рисками»

Дисциплина «Практика управления экономическими рисками» предназначена для магистрантов направления подготовки 38.04.01 Экономика, магистерская программа «Транспорт и пространственная логистика».

Дисциплина «Практика управления экономическими рисками» включена в Блок 1 «Дисциплины (модули)» Обязательная часть.

Общая трудоёмкость освоения дисциплины составляет 3 зачётных единицы, 108 часов. Учебным планом предусмотрены лекционные занятия (9 часов), практические занятия (18 часов, в том числе МАО 9 часов), самостоятельная работа студентов (81 час, в том числе 36 час. на подготовку к экзамену). Дисциплина реализуется на 2 курсе, 3 семестре.

Дисциплина «Практика управления экономическими рисками» базируется на знаниях, умениях и навыках, полученных при освоении дисциплин «Макроэкономика», «Микроэкономика», «Эконометрика», «Статистика» и позволяет подготовить студентов к освоению ряда таких дисциплин, как «Планирование и управление проектами развития инфраструктуры, транспорта и логистики», «Организационные и инвестиционные модели в проектах развития инфраструктуры, транспорта, логистики», прохождению производственной практики, и подготовке выпускной квалификационной работы.

Содержание дисциплины охватывает следующий круг вопросов:

1. Идентификация и оценка рисков: рыночные и специфические риски организаций; риски субъектов российского и международного финансового рынка – риски банковского сектора, риски микрофинансовых организаций, риски лизинговых компаний, риски страховых организаций, риски субъектов пенсионного рынка; расчёт параметров риска; выявление причин возникновения рисков.

2. Методы управления экономическими рисками: избежание, лимитирование, диверсификация, хеджирование, страхование; процедуры и технологии управления рисками.

3. Методы количественной оценки рисков: статистические методы; методы оценки вероятности исполнения; методы анализа вероятностных распределений потоков платежей; имитационное моделирование.

4. Практика риск-менеджмента в компаниях реального сектора: идентификация рисков; международные и российские стандарты управления рисками; этапы формирования стратегии риск-менеджмента.

5. Финансовый риск-менеджмент в компаниях финансового сектора: нормативное регулирование системы риск-менеджмента; международные стандарты управления рисками финансово-кредитных организаций – Базель III, Solvency II; системы внутреннего контроля финансово-кредитных организаций.

5. Практические аспекты управления финансовыми рисками государства: системный подход к управлению экономическими рисками государства; идентификация, классификация, инвентаризация и количественная оценка рисков; риски оперативного управления бюджетными потоками, риски бюджетного учета, риски бюджетного контроля; формирование резервных фондов; способы адаптации финансовой системы к рискам; профилактика, превенция рисков; мониторинг финансовых рисков.

Цель: расширить и углубить знания студентов в области управления экономическими рисками, сформировать компетенции в вопросах разработки стратегии риск-менеджмента участников экономической деятельности.

Задачами курса является формирование компетенций в области:

1. Оценки финансовых рисков;
2. Национальных и международных стандартов риск-менеджмента;
3. Разработки стратегии риск-менеджмента;
4. Оценка эффективности методов управления экономическими рисками.

В результате изучения дисциплины у обучающихся формируются следующие универсальные и общепрофессиональные компетенции:

Код и формулировка компетенции	Индикаторы формирования компетенции
УК-1 Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	УК-1.2 Разрабатывает и содержательно аргументирует стратегию решения проблемной ситуации на основе системного и междисциплинарного подходов, строит сценарии реализации стратегии, определяя возможные риски и предлагая пути их устранения
УК-2 Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1 Разрабатывает методические и нормативные документы, включая план и задания по реализации проекта с учётом фактора неопределённости и возможных рисков
ОПК-4 Способен принимать экономически и финансово обоснованные организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность;	ОПК-4.1 Проводит аналитическую оценку организационно-управленческих решений, выявляет риски возникновения потерь и источники опасности участников экономической деятельности любого уровня и отраслевой принадлежности
	ОПК-4.2 Выбирает оптимальное по заданному экономическому и финансовому критерию организационно-управленческое решение с учётом рисков

Для формирования указанных компетенций в рамках дисциплины «Практика управления экономическими рисками» применяются следующие методы интерактивного обучения:

- технология кейс-стади;
- создание временного проектного коллектива для работы над выполнением творческого задания;
- учебная групповая дискуссия.