

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ «Риск-менеджмент»

по основной профессиональной образовательной программе по направлению подготовки
38.03.01 «Экономика» (уровень бакалавриата)

Направленность (профиль): Экономика и управление организацией

Общий объем дисциплины – 3 з.е. (108 часов)

Форма промежуточной аттестации – Зачет.

В результате освоения дисциплины у обучающихся должны быть сформированы компетенции с соответствующими индикаторами их достижения:

- ПК-13.1: Демонстрирует знания методов анализа и оценки рисков;
- ПК-13.2: Способен осуществлять оценку вероятности наступления рискованных ситуаций;
- ПК-15.1: Демонстрирует знания основных разделов бизнес-планов;
- ПК-15.2: Способен выполнять экономические расчеты бизнес-проектов;

Содержание дисциплины:

Дисциплина «Риск-менеджмент» включает в себя следующие разделы:

Форма обучения очно - заочная. Семестр 8.

1. Понятие риск-менеджмента. Понятия риска, неопределенности, рискменеджмента, отношение к риску, владелец риска, установление контекста, внешний и внутренний контекст, источник риска, события и последствия, классификация риска.

2. Организация системы

риск-менеджмента на

предприятии. Система управления рисками на предприятии, обмен информацией и консультирование, определение ситуации, определение критериев риска, процесс управления рисками.

3. Принципы и концепция

риск-менеджмента. Принципы управления рисками, проект концепции риск-менеджмента, внедрение риск-менеджмента, мониторинг и анализ концепции, постоянное улучшение концепции.

4. Оценка риска. Методы оценки рисков, диагностика рисков, спектр рисков, карта рисков, методология ранжирования блоков/факторов риска, построение карты безразличия, построение кривых безразличия.

5. Идентификация риска и его анализ. Идентификация, анализ риска, определение степени риска. Конкурентная разведка..

6. Обработка риска. Выбор опций обработки риска, подготовка и внедрение планов обработки риска, мониторинг и анализ, запись процессов риск менеджмента, методы воздействия на риск.

7. Инструменты управления кредитным риском. Понятие кредитного риска. Риски до и во время урегулирования. Чувствительность к кредитному риску. Кредитные события: дефолт (кросс-дефолт), банкротство, неплатежеспособность, мораторий на платеж, реструктуризация, досрочное исполнение обязательства. Ожидаемые и неожиданные потери. Процесс восстановления..

8. Методы учета операционных рисков. Понятие и классификация операционных рисков компании. Операционные

валютные риски: их оценка и управление. Измерение валютных операционных рисков.
Маркетинговые стратегии управления валютными операционными рисками.
Использование опционов для хеджирования операционных валютных рисков.

Разработал:
доцент
кафедры МЭО

Т.П. Мильгуй

Проверил:
Директор ИЭиУ

И.Н. Сычева