

## 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