

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего
образования
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА И
ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

Сибирский институт управления – филиал РАНХиГС
Факультет государственного и муниципального управления
Кафедра менеджмента

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ
ДИСЦИПЛИНЫ**

Риск-менеджмент

(Б1.В.22)

краткое наименование дисциплины: не устанавливается

по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент
направленность (профиль): «Менеджмент организации»
квалификация выпускника: Бакалавр
формы обучения: очная, заочная

Год набора 2020

Новосибирск, 2020

Авторы – составители:

доцент кафедры менеджмента	Белая Елена Александровна
доцент кафедры менеджмента	Бондаренко Ирина Викторовна
преподаватель кафедры менеджмента	Иванова Марина Владимировна
доцент кафедры менеджмента	Матюнин Владимир Михайлович
заведующий кафедрой менеджмента	Симагина Ольга Владимировна
доцент кафедры менеджмента	Филиппов Дмитрий Викторович

Цель освоения дисциплины:

Сформировать навыки внедрения регламентов бизнес-процессов в конкретных организациях и ситуациях

План курса:

Раздел 1. Риск как экономическая категория, его сущность и характеристика

Тема 1.1 Риск и его характеристики

Предмет и значение дисциплины. Понятие риска. Предпосылки возникновения риска. Природа риска. Объектный и субъектный подходы к определению категории риск. Неопределенность и риск. Функции риска. Рисковая ситуация. Феномен риска. Классические и неоклассические теории риска. Понятие фактора риска. Информация и риск. Роль информации в теории риска. Спекулятивный и чистый риск. Ситуация риска и ситуация неопределенности. Основные причины неопределенности. Источники предпринимательского риска. Операционные характеристики риска. Потери: понятие, виды. Структура потерь. Значимость потерь. Принципы оценки потерь. Оценка потерь. Потери имущества. Виды оценки потерь имущества. Финансовые потери. Трудовые потери. Потери в результате ответственности.

Тема 1.2 Классификации рисков

Основания и цели классификации рисков. Принципы классификации рисков. Риски: производственные, коммерческие, финансовые. Внутренние и внешние риски. Системные и внесистемные риски. Венчурные риски. Рыночные и нерыночные риски. Виды политических, инвестиционных рисков. Классификация рисков по Ю.Бригхему. Классификация рисков по Э.Уткину. Классификация рисков по М.Г. Лапуста. Классификация рисков по Р.М. Качалову.

Раздел 2. Процесс управления риском: методы анализа и минимизации рисков

Тема 2.1 Оценка риска

Анализ рисков. Идентификация риска. Оценка неопределенности. Теория вероятности и определение риска. Кривая вероятности. Методы расчета (оценки) риска. Статистические методы оценки. Анализ чувствительности. Качественный анализ риска. Методы экспертных оценок. Метод Паттерн. Метод Дельфи. Основные понятия теории стратегических игр. Понятие игры с природой. Выбор решений с помощью дерева решений. Анализ и решение задач с помощью дерева решений. Метод «События — последствия». Метод деревьев отказов. Методы индексов опасности. Оценка размеров возможного ущерба. Интегральная оценка риска. Риски, связанные с нанесением ущерба компании их причины. Оценка венчурных рисков. Персонализация риска, зависимость оценки риска от индивидуальных качеств ЛПР. Конфликтогенность в организации

Тема 2.2 Количественные методы оценки риска

Оценка вероятности риска. Сценарный метод. Оценка риска в теории принятия решений. Имитационное моделирование. Метод Монте-Карло. Графические методы анализа риска. Дерево решений. Теория игр в оценке риска. Анализ риска с учетом склонности к риску лица, принимающего решение. Использование результатов оценки риска.

Понятие инвестиций. Виды инвестиций. Виды инвестиционных рисков. Оценка инвестиционных рисков. Метод средневзвешенной стоимости исходного капитала (WACC). Цена и доходность актива. Виды активов. Оценка риска единичного проекта. Оценка рыночного риска проекта. Оценка внутрифирменного риска. Концепция бета-коэффициента. Характеристика коэффициента чувствительности. Уравнение регрессии. Метод арбитражного ценообразования. Согласование интересов.

Тема 2.3 Методы снижения риска

Снижение риска и стратегия развития фирмы. Мониторинг поля риск-факторов. Меры

по снижению риска. Анализ стоимости риска и мероприятий по его снижению. Анализ стоимости дополнительной информации. Риск и компьютерное моделирование ситуации. Риск и страхование. «Заботливость» предпринимателя. Учет риска в бизнес-планировании. Методы уклонения. Методы локализации. Методы диссипации. Методы компенсации. Специальные методы снижения риска. Передача риска на контрагента.

Самострахование: понятие, виды, особенности. Страхование: понятие, виды. Страхование предпринимательских рисков. Страхование имущественных рисков. Страхуемые и не страхуемые риски. Эффективность страхования рисков. Оценка рисков в страховании. Цена страхования

Тема 2.4 Риск-менеджмент

Информация - основа риск-менеджмента. Стратегии риск-менеджмента. Цели и задачи риск-менеджмента. Планирование и прогнозирование в риск-менеджменте. Обязанности менеджера по риску. Системный подход к снижению хозяйственного риска. Этапы развития теории рисков. Правила риск-менеджмента. Функции риск-менеджмента. Стандарты риск-менеджмента. FERMA. Российский и международный опыт в риск-менеджменте.

Формы и методы текущего контроля успеваемости обучающихся и промежуточной аттестации.

В ходе реализации дисциплины «Риск-менеджмент» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Тема (раздел)		Методы текущего контроля успеваемости
Раздел 1	Риск как экономическая категория, его сущность и характеристика	
Тема 1.1.	Риск и его характеристики	Устный ответ на вопросы Письменный ответ на вопросы
Тема 1.2.	Классификации рисков	Устный ответ на вопросы Письменный ответ на вопросы Решение тестового задания на бумажном носителе
Раздел 2	Процесс управления риском: методы анализа и минимизации рисков	
Тема 2.1	Оценка риска	Устный ответ на вопросы Письменный ответ на вопросы Письменное выполнение практического задания
Тема 2.2.	Количественные методы оценки риска	Устный ответ на вопросы Письменный ответ на вопросы Письменное выполнение практического задания
Тема 2.3.	Методы снижения риска	Устный ответ на вопросы Письменный ответ на вопросы Письменное выполнение практического задания
Тема 2.4.	Риск-менеджмент	Устный ответ на вопросы Письменный ответ на вопросы Решение тестового задания на бумажном носителе
Выполнение контрольной работы по курсу		Письменное выполнение контрольной работы по разделам 1-2

Зачет проводится в форме тестирования, экзамен проводится в форме устных/письменных ответов на вопросы билета.

Основная литература:

1. Афонин, П. Н. Методология управления рисками [Электронный ресурс] : учеб. пособие для специальности «Таможенное дело» / П. Н. Афонин, Д. Н. Афонин. — Электрон. дан.

- Санкт-Петербург : Интермедия, 2016. — 264 с. — Доступ из ЭБС «IPRbooks». — Режим доступа : <http://www.iprbookshop.ru/54379>, требуется авторизация (дата обращения : 18.08.2016). — Загл. с экрана.
2. Балдин, К. В. Управление рисками [Электронный ресурс] : учеб. пособие / К. В. Балдин. — Электрон. дан. — Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2012. — 512 с. — Доступ из ЭБС «IPRbooks». - Режим доступа : <http://www.iprbookshop.ru/10513>, требуется авторизация (дата обращения : 18.08.2016). — Загл. с экрана.
 3. Воробьев, С. Н. Управление рисками [Электронный ресурс] : учеб. пособие / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - Электрон. дан. — Москва : Юнити-Дана, 2012. - 512 с. — Доступ из ЭБС «Унив. б-ка ONLINE». - Режим доступа : <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=117545>, требуется авторизация (дата обращения : 18.08.2016). — Загл. с экрана.
 4. Воронцовский, А. В. Управление рисками [Электронный ресурс] : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. — Электрон. дан. – Москва : Юрайт, 2016. — 414 с. — Доступ из ЭБС изд-ва «Юрайт». — Режим доступа : <https://www.biblio-online.ru/book/27AFED57-ABAE-404E-9BD5-7AC50A910E5E>, требуется авторизация (дата обращения : 18.08.2016). — Загл. с экрана.
 5. Вяткин, В. Н. Риск-менеджмент [Электронный ресурс] : учебник / В. Н. Вяткин, В. А. Гамза, Ф. В. Маевский. – 2-е изд., перераб. и доп. — Электрон. дан. – Москва : Юрайт, 2016. – 365 с. — Доступ из ЭБС изд-ва «Юрайт». — Режим доступа : <https://www.biblio-online.ru/book/9C57A6F5-784B-4032-AE44-CF5A1F2484CA>, требуется авторизация (дата обращения : 18.08.2016). — Загл. с экрана.
 6. Управление финансовыми рисками [Электронный ресурс] : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / И. П. Хоминич [и др.] ; под ред. И. П. Хоминич, И. В. Пещанской. — Электрон. дан. – Москва : Юрайт, 2016. — 345 с. — Доступ из ЭБС изд-ва «Юрайт». — Режим доступа : <https://www.biblio-online.ru/book/ACB0B5A6-07FA-48D1-B455-387D7B816AB4>, требуется авторизация (дата обращения : 18.08.2016). — Загл. с экрана.