

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.В.01 «Управление рисками»

Автор:

Доцент кафедры государственной и муниципальной службы и кадровой политики,
к.т.н., Шахворостов Г.И.

по направлению подготовки 38.03.04 «Государственное и муниципальное управление»,
профиль «Государственные и муниципальные финансы»

квалификация бакалавр

формы обучения заочная

Цель освоения дисциплины:

Сформировать компетенции:

- ПК-1 умение определять приоритеты профессиональной деятельности, разрабатывать и эффективно исполнять управленческие решения, в том числе в условиях неопределенности и рисков, применять адекватные инструменты и технологии регулирующего воздействия при реализации управленческого решения.

Алгоритм формирования компетенции базируется на представлениях:

1. о классификации риска.
2. о системе управления риском.
3. о измерении риска и критериях принятия рискованных решений.

План курса:

№ п/п	Наименование тем	Краткое описание тем
1	Понятие и сущность риска. Риск как объект управления.	Понятие риска и основные черты риска. Особенности принятия решений в условиях неопределенности будущих результатов. Риски бизнеса в реальном секторе экономики. Основные проблемы управления рисками в реальном бизнесе.
2	Факторы риска	Основные разновидности факторов риска. Внешние и внутренние факторы риска.
3	Стратегии рискованных решений и основные методы управления рисками	Особенности современной экономики и их влияние на стратегии развития бизнеса. Основные стратегии развития бизнеса и управления рисками. Основные методы управления рисками.
4	Измерения риска и критерии принятия рискованных решений	Формализация условий ситуации риска. Измерение риска. Косвенные методы учета риска. Критерии оценки рискованных решений.
5	Анализ чувствительности риска при обосновании долгосрочных проектов материальных инвестиций	Анализ чувствительности как метод оценки устойчивости инвестиционного проекта. Аналитический подход к анализу чувствительности. Дискретный анализ чувствительности. Метод Монте-Карло.

№ п/п	Наименование тем	Краткое описание тем
6	Измерения риска долгосрочных инвестиционных проектов	Основные меры риска долгосрочного инвестиционного проекта. Оценка риска долгосрочного инвестиционного проекта на основе дерева событий. Оценка риска по методу сценариев будущего развития. Использование дерева решений при оценке риска инвестиционных проектов.
7	Оперативное управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта	Основные особенности организации управления риском. Управление риском на основе долгосрочного прекращения проектов. Оперативное управление риском на основе увеличения расходов на рекламу. Управление риском с помощью диверсификации.
8	Управление рисками проектов долгосрочных инвестиций с помощью реальных опционов	Реальные опционы: определения, виды и характеристики. Использование простых реальных опционов для управления рисками. Комбинированные реальные опционы. Встроенный реальный опцион на развитие бизнеса. Влияния реальных опционов на оценку инвестиций и стоимость рискованных активов капитала.
9	Управление рисками с помощью стратегий смешанного типа на основе реальных опционов	Использование комбинаций реальных опционов для управления рисками инвестиционных проектов. Некоторые возможности формирования решений смешанного типа по управлению рисками.
10	Управление рисками в условиях использования лизинга	Некоторые особенности лизинговых контрактов. Особенности условий лизинга. Управление рисками с помощью реальных опционов, встроенных в лизинговый контракт.
11	Использование теории опционов для оценки рискованных инвестиций и стоимости бизнеса	Рыночный опцион как форма условного срочного контракта. Модель равновесной цены опциона на основе стоимости эквивалентного портфеля. Оценка рискованных активов капитала на примере обоснования предельной стоимости участка земли под застройку. Управление рисками с помощью условных и безусловных срочных контрактов на продажу продукции. Сравнительный анализ применения реального опциона и безусловного срочного контракта на продажу продукции для управления рисками.

Формы текущего контроля

направленные на контроль усвоения знаний:

- об основах теории риска;
- о специфике и особенностях оценки управления рисками в реальном секторе экономики;
- о процедурах планирования и реагирования на риски.
опрос, тестирование,

направленные на формирование умений:

- формировать необходимую исходную информацию для оценки риска и обоснования управления рисками;
- выполнять комплексы расчетов на ЭВМ в пакете Microsoft Excel.

практическая работа

направленные на формирование навыков:

- применения методов анализа и управления рисками;
- применения стандартных подходов к решению кризисной и рискованной ситуации.

практическая работа

Форма промежуточной аттестации - экзамен

Основная литература (библиотечный фонд):

1. Мамаева Л.Н. Управление рисками: учебное пособие / Л.Н. Мамаева. 2-е изд. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К», 2014. – 256 с.
2. Воронцовский, А. В. Управление рисками : учебник и практикум для бакалавриата и магистратуры / А. В. Воронцовский. — М. : Издательство Юрайт, 2017. — 414 с.
3. Балдин К.В. Управление рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012.— 512 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10513>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю