

Аннотация рабочей программы дисциплины

Б1.В.ДВ.01.02 «Оценка и управление рисками коммерческих организаций»

Направление подготовки

38.04.01 Экономика (уровень магистр)

направленность (профиль) программы: "Экономика коммерческих организаций"

Рабочая программа учебной дисциплины соответствует требованиям
ФГОС ВО по направлению 38.04.01 «Экономика».

1. Место дисциплины в структуре ОПОП:

Учебная дисциплина «Оценка и управление рисками коммерческих организаций» входит в вариативную (профильную) часть профессионального цикла (Б1.В.ДВ.1.2) ООП магистратуры по направлению «Экономика» для профиля «Экономика и управление организацией».

2. Цель и задачи дисциплины, требования к результатам освоения дисциплины:

Целью дисциплины является: подготовка обучаемых к работе по оценке и управлению рисками коммерческой организации.

Задачей дисциплины является: выработка у обучаемых необходимых знаний, умений и навыков, позволяющих им выполнять основные виды профессиональной деятельности в сфере оценки и управления рисками коммерческих организаций с учетом сложившейся конъюнктуры рынка.

Формируемые компетенции:

В результате освоения дисциплины должны быть сформированы следующие компетенции:

Вид деятельности: аналитическая

ПК-8 способность готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне.

В результате освоения компетенции **ПК-8** магистрант должен:

- 1. Знать:** способы подготовки аналитических материалов для оценки мероприятий в области экономической политики и т.д.
- 2. Уметь:** собирать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет
- 3. Владеть:** навыками анализа и интерпретации финансовой, бухгалтерской и иной информации, содержащейся в отчетности предприятий различных форм собственности, а также в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне.

ПК-9 способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов

В результате освоения компетенции **ПК-9** магистрант должен:

- 1. Знать:** методы анализа исходных данных, необходимых для расчета финансово-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов

2. **Уметь:** собирать и анализировать данные, необходимые для расчета экономических и финансовых показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов;
3. **Владеть:** навыками анализа данных для расчета финансово-экономических показателей предприятия

Вид деятельности: организационно-управленческая

ПК-12 - способность разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности.

В результате освоения компетенции **ПК-12** магистрант должен:

1. **Знать:** критерии социально-экономической эффективности и возможности использования для решения аналитических и исследовательских задач современных технических средств и информационных технологий
2. **Уметь:** оценить предлагаемые варианты управленческих решений и разработать и обосновать предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий;
3. **Владеть:** навыками обоснования предложения по их совершенствованию с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков и возможных социально-экономических последствий

Содержание дисциплины.

Раздел 1. Теоретические особенности рисков, риски предпринимательской деятельности

Тема 1. Процесс управления риском предпринимательской деятельности.

Понятие Рисковой ситуации. Объективные причины риска. Понятие предпринимательского и финансового риска. Субъективная природа предпринимательского риска. Модификации рисковых явлений. Классификация риска, существующие подходы. Информационно-методическое и правовое обеспечение. Виды предпринимательских рисков для предприятий различных отраслей. Предпринимательские риски торговых предприятий. Задачи управления риском. Основные принципы управления риском. Идентификация внутренних и внешних факторов риска. Ранжирование рисков. Этапы управления. Методы управления риском. Лимитирование. Хеджирование. Механизм разработки мер по снижению риска на предприятии. Построение модели управления риском.

Тема 2. Методы оценки предпринимательских рисков

Анализ исходных данных для. Определение рисков при постановке миссии и целей компании. Критерии оптимальности. Теория игр. Оптимальность по Парето. Статистические методы принятия решений в условиях неопределенности. Аналитические методы. Метод чувствительности критических отношений. Коэффициент VaR. Волатильность. Коэффициент вариации. Бета-коэффициент. Метод анализа сценариев: сравнительная оценка вариантов решений. Имитационное моделирование. Оценка целесообразности затрат. Методы расчета интегральных показателей риска. Модели прогнозирования риска банкротства. Метод экспертных оценок. Метод «мозговой атаки». Синектический метод. Метод Делфи. Метод ПАТТЕРН. Метод аналогий. Качественные модели прогнозирования риска банкротства.

Раздел 2. Методы управления предпринимательскими рисками на предприятии

Тема 3. Способы снижения предпринимательских рисков

Уклонение от риска. Методы оптимизации риска. Диверсификация риска. Методы локализации риска. Диссипация риска. Информатизация процесса управления. Анализ и прогнозирование денежных потоков. Учет рисков с использованием ставки дисконтирования. Коммерческие, предпринимательские и финансовые риски как объект страховой защиты. Самострахование. Страхование от простоев предприятия. Страхование прибыли, доходов, арендных платежей. Страхование финансовых рисков, связанных с ключевой фигурой бизнеса. Страхование риска непредвиденных судебных расходов. Страхование риска банкротства. Страхование кредитных рисков. Страхование банковских рисков. Страхование инвестиций.

Тема 4. Финансовые риски: оценка и управление ими на коммерческом предприятии.

Финансовая среда предпринимательства. Государственное регулирование и формирование финансовой среды предпринимательства. Виды финансовых рисков. Управление финансовыми рисками. Риск инвестиционной деятельности. Методы оценки риска инвестиций.

Объем дисциплины для магистерской программы «Оценка и управление рисками коммерческих организаций» - 108 часов, в том числе 8 часов лекций и 20 часов практических занятий.

Объем дисциплины 3 з.е./108 часа.

Семестр: 3.

Форма промежуточного контроля - зачет.

Разработчики: Тетенова И.А. ст. преп. кафедры экономического анализа и статистики.