

**Аннотация к рабочей программе
дисциплины «Управление рисками и моделирование рисковых ситуаций»**

Направление подготовки: 38.03.01 «Экономика»

Направленность (профиль): Бизнес-аналитика и цифровая экономика

Квалификация выпускника: бакалавр

Цель освоения дисциплины: изучение предмета, объектов, цели и практических навыков в области организации и управления рисками в деятельности хозяйствующих субъектов, разработки экономически эффективных финансовых и инвестиционных решений.

Объем дисциплины: 3 зачетных единиц, всего 108 часов

Семестр: 8

Краткое содержание основных разделов дисциплины:

№ п/п раздела	Основные разделы дисциплины	Краткое содержание разделов дисциплины
1	Место и роль экономических рисков в управлении деятельностью организации	Место и роль рисков в экономической деятельности. Система управления рисками. Определение степени рисков. Зонирование областей потерь по степени риска. Критерии потерь основных зон риска. Математические методы оценки экономических рисков
2	Риски предприятий сферы сервиса	Сервисные технологии. Классификация рисков предприятий сферы сервиса. Динамический анализ ситуации на рынке услуг. Картографирование рисков. Построение карты рисков и рискография. Табличное представление информации в разных стандартах по риск-менеджменту
3	Риск-менеджмент - система управления риском	Сущность и содержание риск-менеджмента. Разработка программы действий по снижению риска: последовательность стадий. Программное обеспечение для риск-менеджмента (ModelRisk, SIPmath, @Risk, AnyLogic Simulation) Особенности принятия решений в области риск-менеджмента. Эвристические правила риск-менеджмента и их действие. Коэффициент риска. Организационные структуры службы риск-менеджмента. Процессный подход к риск-менеджменту в организации. Внешний и внутренний мониторинг рисков. Планирование в системе риск-менеджмента.

4	Стратегия риск-менеджмента	<p>Понятие стратегии риск-менеджмента. Основные правила стратегии риск - менеджмента и их действие. Принципы управления риском. Приемы управления риском. Средства разрешения риска (избежание, удержание, передача, снижение степени риска).</p> <p>Способы снижения риска. Диверсификация. Поиск информации. Ассиметрия информации. Оценка эффективности приобретаемой информации. Лимитирование. Объединение риска. Самострахование. Страхование.</p>
5	Методы управления финансовыми рисками	<p>Особенности рынка срочных контрактов и его виды. Фьючерсные контракты. Специфика фьючерсных сделок. Форвардные контракты, их специфика. Форвардный курс. Особенности риска форвардных сделок.</p>

Форма промежуточной аттестации: зачет с оценкой