Наименование программы

**«Риск-менеджмент»**

Рабочие программы учебных дисциплин (модулей), практик и стажировок

Дисциплина (Модуль) 1. Наименование дисциплины (модуля).

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **№****п/п** | **Наименование тем**  | **Содержание обучения по темам, наименование и тематика практических занятий, самостоятельной работы слушателя**  |
| 1.1 | Введение в риск-менеджмент. Современная теория финансового менеджмента: основные этапы развития.  Роль риск-менеджмента в деятельности финансовых и промышленных организаций. Международные стандарты риск-менеджмента. Российские ГОСТы риск-менеджмента. Мотивация интереса к риск-менеджменту. Основные характеристики риск-менеджмента в финансовой сфере. | Определение понятия риски, управление рисками. Определение разницы риски и угрозы. Обзор зарубежных и отечественных стандартов в управлении рисками. Основные инструменты работы по управлению рисками. Механизмы выявления и оценки рисков.Организация системы управления рисками в компании. Аналитические инструменты в риск менеджменте..  |
| 1.2 | Финансовые риски: сущность, понятия, классификация. Рыночные риски. Кредитные риски. Риски ликвидности.  Операционные риски.       Неявные риски. Основы финансовой математики. Методы оценки и управления рыночным риском. Методы оценки и управления кредитным риском. Методы оценки и управления операционными рисками. Классификация операционных рисков.  Что мешает принятию решений в риск-менеджменте | Классификация рисков. Временная стоимость денег. Аннуитеты. Оценка стоимости акций и облигаций. Введение в статобработку (среднее, дисперсия и корреляция). Теория диверсификации Марковица модель оценки доходности активов САРМ Шарпа. Линейная парная и множественная регрессия. Концепция рисковой стоимости (Value at Risk - VaR). Методы расчета VaR (параметрический, историческое моделирование, стохастиче-ское моделирование по Монте-Карло. Риск-менеджмент как инструмент принятия стратегических решений.  Факторы возникновения концепции корпоративного риск-менеджмента. Организационное сопровождение. Оценка результатов деятельности с учетом риска: концепции экономической добавленной стоимости (EVA/SVA) и скорректированный на риск рентабельности капитала (RAROC). Проверка на устойчивость к экстремальным событиям |
| 1.3.  | Практические занятия | Примеры практического применения риск- менеджмента в управлении процессами на предприятии. Качественный анализа (составление карты рисков, дерева решений). Работа с инструментами риск - менеджмента. Выявление причинно - следственной связи процессов в компании (построение диаграммы Исикава). (практические занятия, , круглые столы, мастер-классы)  |
|   |  |  |