

Пензенский государственный университет

Факультет экономики и управления

### **Аннотация рабочей программы учебной дисциплины**

#### **«Анализ и управление рисками в бизнесе»**

*Целью* освоения учебной дисциплины «Анализ и управление рисками в бизнесе» являются дать представление об основах моделирования экономических процессов в условиях риска, способствовать приобретению навыков в определении оптимальных стратегий в ситуациях, связанных с риском на основе использования экономико-математических методов.

Учебная дисциплина «Анализ и управление рисками в бизнесе» входит в вариативную часть цикла дисциплин по выбору студентов Б.1. Курс рассчитан на студентов, «входные» *знания и умения* которых определяются программами дисциплин «Экономика предприятия», «Теория вероятностей и математическая статистика»; «Бизнес-прогнозирование»; «Управление информационной безопасностью ИТ-инфраструктуры предприятия», «Имитационное моделирование», «Исследование операций».

*Задачи* освоения учебной дисциплины «Анализ и управление рисками в бизнесе».

Изучение дисциплины «Анализ и управление рисками в бизнесе» позволит бакалаврам по направлению «Бизнес-информатика» развить профессиональные компетенции, связанные с построением моделей, адекватно учитывающих рисковые ситуации, позволяющей принять оптимальные решения относительно рисков; с применением методов моделирования рисковых ситуаций, как в научных исследованиях, так и на практике. Названные компетенции являются неотъемлемыми компонентами высокого уровня квалификации специалистов.

*Содержание* учебной дисциплины «Анализ и управление рисками в бизнесе».

**Раздел 1.** Общие представления об экономических рисках

**Раздел 2.** Методы оценки экономических рисков

**Раздел 3.** Способы моделирования рисковых ситуаций

**Раздел 4.** Моделирование инвестиционных рисков

**Раздел 5.** Хеджирование рисков

**Раздел 6.** Моделирование рисков инвестиционных проектов

**Раздел 7.** Моделирование производственных рисков

**Раздел 8.** Переход к интегрированной системе управления рисками