

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ  
Федеральное государственное автономное учреждение  
высшего профессионального образования  
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"  
Центр заочного и дистанционного обучения



УТВЕРЖДАЮ

Проректор по образовательной деятельности КФУ

Проф. Талюцкий Д.А.

  
КАЗАНСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ  
ДЕПАРТАМЕНТ  
ОБРАЗОВАНИЯ  
(ДО КФУ)

\_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

*подписано электронно-цифровой подписью*

**Программа дисциплины**  
Система управления рисками Б1.В.ОД.17

Направление подготовки: 38.03.02 - Менеджмент

Профиль подготовки: Менеджмент организации

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: на базе СПО

Язык обучения: русский

**Автор(ы):**

Хайруллина А.Д.

**Рецензент(ы):**

Большов А.В.

**СОГЛАСОВАНО:**

Заведующий(ая) кафедрой: Палей Т. Ф.

Протокол заседания кафедры No \_\_\_\_ от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 201\_\_ г

Учебно-методическая комиссия Института управления, экономики и финансов (центр заочного и дистанционного обучения):

Протокол заседания УМК No \_\_\_\_ от " \_\_\_\_ " \_\_\_\_\_ 201\_\_ г

Регистрационный No 9549109717

Казань  
2017

## Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. (доцент) Хайруллина А.Д. кафедра общего менеджмента Институт управления, экономики и финансов , AIDHajrullina@kpfu.ru

### 1. Цели освоения дисциплины

Цель изучения дисциплины состоит в освоении основ риск-менеджмента организации. Изучение данной дисциплины позволит получить и развить знания в области инструментов анализа и оценки предпринимательских рисков, а также даст возможность овладеть навыками применения научных приемов снижения рисков в предпринимательской среде.

### 2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б1.В.ОД.17 Дисциплины (модули)" основной образовательной программы 38.03.02 Менеджмент и относится к обязательным дисциплинам. Осваивается на 3 курсе, 6 семестр.

Изучение курса "Риск-менеджмент" возможно на базе знаний, полученных студентами в результате изучения таких дисциплин, как "Экономическая теория", "Эконометрика", "Менеджмент", "Экономика и организация производства", "Антикризисный менеджмент".

### 3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
Пк-11	владением навыками анализа информации о функционировании системы внутреннего документооборота организации, ведения баз данных по различным показателям и формирования информационного обеспечения участников организационных проектов
ПК-15 (профессиональные компетенции)	умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании
ПК-17 (профессиональные компетенции)	способностью оценивать экономические и социальные условия осуществления предпринимательской деятельности, выявлять новые рыночные возможности и формировать новые бизнес-модели
ПК-9 (профессиональные компетенции)	способностью оценивать воздействие макроэкономической среды на функционирование организаций и органов государственного и муниципального управления, выявлять и анализировать рыночные и специфические риски, а также анализировать поведение потребителей экономических благ и формирование спроса на основе знания экономических основ поведения организаций, структур рынков и конкурентной среды отрасли

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

теоретические и практические основы построения системы риск-менеджмента на предприятии;

- методические приемы анализа и оценивания нефинансовых рисков;

- пути снижения рисков предпринимательской деятельности;

- современные аспекты риск-менеджмента в предпринимательской среде.

2. должен уметь:

- анализировать рисковую ситуацию;
- выявлять и идентифицировать предпринимательские риски предприятия;
- оценивать возможность принятия рискованного решения предприятием;
- применять методы оценки риска

3. должен владеть:

- навыками идентификации рискованных факторов;
- навыками анализа и оценки рисков;
- инструментами теории игр в принятии рискованных решений;
- построения карты рисков организации;
- методами выбора антирисковых мероприятий.

4. должен демонстрировать способность и готовность:

ОК-15, ПК-8, ПК-31, ПК-32, ПК-◆◆, ПК-40, ПК-42, ПК-48, ПК-50.

#### 4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет зачетных(ые) единиц(ы) 108 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины зачет в 6 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

#### 4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

##### Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Сущность риска и его роль в развитии организации	6	1	0	0	0	Письменное домашнее задание

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
2.	Тема 2. Комплексная система риск-ориентированного менеджмента организации	6	2	0	2	0	Презентация
3.	Тема 3. Идентификация и измерение рисков деятельности организации	6	3	2	0	0	Творческое задание
4.	Тема 4. Оценка влияния рисков на организацию	6	4	0	0	0	Письменная работа
5.	Тема 5. Методы воздействия на риски организации	6	5	0	2	0	Контрольная работа
	Тема . Итоговая форма контроля	6		0	0	0	Зачет
	Итого			2	4	0	

#### 4.2 Содержание дисциплины

##### Тема 1. Сущность риска и его роль в развитии организации

##### Тема 2. Комплексная система риск-ориентированного менеджмента организации *практическое занятие (2 часа(ов)):*

1.Цели и задачи комплексного риск-менеджмента организации. 2. Элементы системы риск-менеджмента организации. 3. Управляющая и управляемая подсистемы риск-менеджмента. 4. Принципы информационного обеспечения системы управления риском предприятия. 5.Современные стандарты системы риск-менеджмента.

##### Тема 3. Идентификация и измерение рисков деятельности организации *лекционное занятие (2 часа(ов)):*

Процедурные аспекты идентификации рисков. Техники и инструменты идентификации рисков рискообразующих факторов. Психологическая основа риск-менеджмента. Экспертные технологии в определении и измерении рисков. Анализ причинно-следственных связей рисковых факторов. Списки рисков. Ранжирование рисков. Построение риск-профиля предприятия. Разработка карты (матрицы) рисков.

##### Тема 4. Оценка влияния рисков на организацию

##### Тема 5. Методы воздействия на риски организации *практическое занятие (2 часа(ов)):*

Стратегии поведения в рисковомой ситуации. 2. Отказ от риска. Концепция приемлемого риска. 3. Снижение риска. 4. Передача риска. 5. Мониторинг риска.

#### 4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
1.	Тема 1. Сущность риска и его роль в развитии организации	6	1	подготовка домашнего задания	10	письменное домашнее задание
				подготовка домашнего задания	10	домашнее задание
2.	Тема 2. Комплексная система риск-ориентированного менеджмента организации	6	2	подготовка к презентации	20	презентация
3.	Тема 3. Идентификация и измерение рисков деятельности организации	6	3	подготовка к творческому экзамену	20	творческое задание
4.	Тема 4. Оценка влияния рисков на организацию	6	4	подготовка к письменной работе	18	письменная работа
5.	Тема 5. Методы воздействия на риски организации	6	5	подготовка к контрольной работе	20	контрольная работа
	Итого				98	

## 5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

активные и интерактивные формы проведения занятий (компьютерные симуляции, деловые и ролевые игры, разборы конкретных ситуаций, психологические и иные тренинги) в сочетании с внеаудиторной работой с целью формирования и развития профессиональных навыков обучающихся.

## 6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

### Тема 1. Сущность риска и его роль в развитии организации

домашнее задание , примерные вопросы:

Изучить рейтинги страновых рисков.

письменное домашнее задание , примерные вопросы:

Исследовать отраслевые особенности рискованной деятельности.

### Тема 2. Комплексная система риск-ориентированного менеджмента организации

презентация , примерные вопросы:

Подготовить презентацию на тему "Сравнительная характеристика Стандартов риск-менеджмента"

### Тема 3. Идентификация и измерение рисков деятельности организации

творческое задание , примерные вопросы:

Идентифицировать риски организации

### Тема 4. Оценка влияния рисков на организацию

письменная работа , примерные вопросы:

Проанализировать и оценить риски конкретного бизнес-проекта организации.

### **Тема 5. Методы воздействия на риски организации**

контрольная работа , примерные вопросы:

Контрольная работа по современным методам снижения рисков

### **Тема . Итоговая форма контроля**

Примерные вопросы к зачету:

Примерный перечень вопросов для изучения:

1. Понятие риска, его основные черты. Классическая и неоклассическая теории риска.
2. Принципы классификации рисков.
3. Цели и задачи комплексного риск-менеджмента.
4. Элементы системы управления рисками предприятия.
5. Современные стандарты системы риск-менеджмента.
6. Принципы информационного обеспечения системы управления риском предприятия.
7. Процедура идентификации рисков предприятия.
8. Методы выявления рисков и рискообразующих факторов.
9. Техники и инструменты идентификации рисков.
10. Психологическая основа принятия рискованных решений.
11. Экспертные технологии в определении и измерении рисков.
12. Риск-профиль предприятия.
13. Матрица рисков предприятия.
14. Принятие рискованных решений на основе дисперсионного метода.
15. Интервальный (балансовый) метод оценки рискового потенциала предприятия.
16. Анализ чувствительности как метод оценки рисков организации.
17. Сценарный анализ как метод оценки рисков организации.
18. Использование показателя VaR для измерения величины рисков организации.
19. Стратегии поведения предприятия в рискованной ситуации.
20. Уклонение от риска: преимущества и недостатки.
21. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска (вероятности/ущерба).
22. Пути снижения частоты ущерба или предотвращения убытка.
23. Способы уменьшения размера убытков предприятия.
24. Инструменты разделения риска: дифференциация и дублирование.
25. Аутсорсинг риска: преимущества и недостатки.
26. Финансирование рисков предприятия.
27. Внутренние и внешние источники покрытия убытков от рисков.
28. Мониторинг рисков.

#### **7.1. Основная литература:**

1. Никонов В. Управление рисками: Как больше зарабатывать и меньше терять / В.Никонов. - М.: Альпина Паблишерз, 2009. - 285с. // [http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=9683&ln=ru&search\\_query](http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=9683&ln=ru&search_query)
2. Минкова Е.С. Управленческая рискология : учебное пособие / Е.С. Минкова. - Калининград: Изд-во РГУ им. И. Канта, 2007. // [http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=7649&ln=ru&search\\_query](http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=7649&ln=ru&search_query)
3. Бочаров С.А., Иванов А.А., Олейников С.Я. Риск-менеджмент : учебно-методический комплекс / С.А. Бочаров, А.А. Иванов, С.Я. Олейников. - М.: Изд. центр ЕАОИ, 2011. - 304с. // [http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=6515&ln=ru&search\\_query](http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=6515&ln=ru&search_query)



## 7.2. Дополнительная литература:

1. Крышкин О. Настольная книга по внутреннему аудиту : риски и бизнес-процессы /О. Крышкин. - М.: Альпина паблишер, 2011 // [http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=9923&search\\_query](http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=9923&search_query)
2. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия : учебное пособие / К.В. Балдин, И.И. Передеряев, Р.С. Голов. - 3-е изд. - М.: издательско-торговая корпорация "Дашков и Ко". - 420 с. // [http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=7770&ln=ru&search\\_query](http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=7770&ln=ru&search_query)
3. Энциклопедия финансового риск менеджмента / под ред. Лобанова А.А. и Чугунова А.В.- М: Альпина Бизнес Букс, 2009. - 932с. // [http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=9880&ln=ru&search\\_query=](http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=9880&ln=ru&search_query=)

## 7.3. Интернет-ресурсы:

Журнал - [www.in.sure.ru](http://www.in.sure.ru)  
Сайт - [www.allinsurance.ru](http://www.allinsurance.ru)  
сайт - [www.riskmetrics.com](http://www.riskmetrics.com)  
сайт - [www.riskofficer.ru](http://www.riskofficer.ru)  
Сайт - [www.risk-academy.ru](http://www.risk-academy.ru)

## 8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Система управления рисками" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

проектор, ноутбук, компьютерный класс

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 38.03.02 "Менеджмент" и профилю подготовки Менеджмент организации .



Автор(ы):

Хайруллина А.Д. \_\_\_\_\_

"\_\_" \_\_\_\_\_ 201\_\_ г.

Рецензент(ы):

Большов А.В. \_\_\_\_\_

"\_\_" \_\_\_\_\_ 201\_\_ г.