

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное учреждение
высшего профессионального образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Институт управления и территориального развития



УТВЕРЖДАЮ

Проректор
по образовательной деятельности КФУ
Проф. Минзарипов Р.Г.

"__" _____ 20__ г.

Программа дисциплины
Управление рисками М2.ДВ.1

Направление подготовки: 080500.68 - Бизнес-информатика

Профиль подготовки: Аналитика в управлении бизнесом

Квалификация выпускника: магистр

Форма обучения: очное

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 и территориального развития:

Протокол заседания УМК No ____ от "____" _____ 201__ г

Регистрационный No

Казань
2014

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 отделение менеджмента и маркетинга , AIDHajrullina@kpfu.ru

1. Цели освоения дисциплины

Цель изучения дисциплины состоит в освоении основ управления рисками 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 " М2.ДВ.1 Профессиональный" основной образовательной программы 080500.68 Бизнес-информатика и относится к дисциплинам по выбору. Осваивается на 1 курсе, 2 семестр.

Изучение курса "Управление рисками" возможно на базе знаний, полученных студентами в результате изучения ряда дисциплин в рамках бакалавриата, таких как "Макроэкономика", "Микроэкономика", "Менеджмент".

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

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ОК-2 (общекультурные компетенции)	способен к самостоятельному освоению новых методов исследования, изменению научного и научно - производственного профиля своей профессиональной деятельности
ОК-5 (общекультурные компетенции)	способность к творческой адаптации к конкретным условиям выполняемых задач и их инновационным решениям
ПК-3 (профессиональные компетенции)	применять методы системного анализа и моделирования для анализа архитектуры предприятий

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

теоретические и практические основы построения системы управления рисками на предприятии;

- методические приемы управления рисками;
- пути снижения рисков предприятий;
- современные аспекты управления рисками в предпринимательской среде.

2. должен уметь:

- анализировать внешнюю и внутреннюю среду предприятия на предмет наличия рисков;
- выявлять и идентифицировать предпринимательские риски предприятия;

- оценивать возможность принятия рискованного решения предприятием;
- применять методы оценки риска

3. должен владеть:

- навыками идентификации рисков;
- навыками анализа и оценки рисков;
- методами выбора антирисковых мероприятий.

применять полученные знания на практике

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

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

Форма промежуточного контроля дисциплины зачет во 2 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	2	1	2	4	0	домашнее задание
2.	Тема 2. Комплексная система риск-ориентированного менеджмента организации	2	2	4	6	0	презентация
3.	Тема 3. Идентификация и измерение рисков деятельности организации	2	3	2	4	0	творческое задание
4.	Тема 4. Оценка влияния рисков на организацию	2	4	4	6	0	письменная работа

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
5.	Тема 5. Методы воздействия на риски организации	2	5	2	4	0	контрольная работа
	Тема . Итоговая форма контроля	2		0	0	0	зачет
	Итого			14	24	0	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Сущность риска и его роль в развитии организации

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Понятие риска, его основные черты. Источники возникновения предпринимательского риска. Классическая и неоклассическая теории предпринимательского риска. Подходы к классифицированию предпринимательских рисков организации. Проблемы риск-менеджмента в условиях российского предпринимательства. Рейтинг рискового предпринимательства.

практическое занятие (4 часа(ов)):

1. Рисковые виды предпринимательства в России и за рубежом. 2. Природа риска. 3. Классификация рисков. 4. риск и неопределенность.

Тема 2. Комплексная система риск-ориентированного менеджмента организации

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Понятие риска, его основные черты. Источники возникновения предпринимательского риска. Классическая и неоклассическая теории риска. Подходы к классифицированию предпринимательских рисков организации. Проблемы риск-менеджмента в условиях российского предпринимательства. Рейтинг рискового предпринимательства.

практическое занятие (6 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 рисков факторов. Списки рисков. Ранжирование рисков. Построение риск-профиля предприятия. Разработка карты (матрицы) рисков.

практическое занятие (4 часа(ов)):

1. Процедура идентификации предпринимательских рисков. 2. Инструменты идентификации рисков. 3. Реестр рисков. 4. Матрица рисков.

Тема 4. Оценка влияния рисков на организацию

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Две стороны риска: вероятность потерь и величина потерь. Дисперсия как мера риска потерь предприятия. Принятие рискованных решений на основе показателей математического ожидания, дисперсии и коэффициента вариации. Интервальный (балансовый) метод оценки рискованного потенциала предприятия. Анализ чувствительности как метод оценки предпринимательских рисков организации. Сценарный анализ в риск-менеджменте. Использование показателя VaR для измерения величины предпринимательских рисков организации.

практическое занятие (6 часа(ов)):

1. Математические модели и методы обоснования рискованных предпринимательских решений. 2. Оценка тяжести последствия рискованного события. 3. Пороговые значения риска для организации. 4. Интегральные показатели оценки риска.

Тема 5. Методы воздействия на риски организации

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Возможные реакции предприятия на рискованную ситуацию. Стратегии поведения в рискованной ситуации (уклонение, сокращение, передача). Прогнозирование рисков. Метод отказа от риска. Концепция приемлемого риска. Пороговые значения риска (вероятности/ущерба). Метод снижения частоты ущерба или предотвращения убытка. Метод уменьшения размера убытков. Метод разделения риска (дифференциация и дублирование). Метод аутсорсинга риска. Методы покрытия убытков (финансирования рисков). Источники покрытия убытков.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Стратегии поведения в рискованной 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	2	1	подготовка домашнего задания	10	домашнее задание
2.	Тема 2. Комплексная система риск-ориентированного менеджмента организации	2	2	подготовка к презентации	10	презентация
3.	Тема 3. Идентификация и измерение рисков деятельности организации	2	3	подготовка к творческому экзамену	16	творческое задание
4.	Тема 4. Оценка влияния рисков на организацию	2	4	подготовка к письменной работе	16	письменная работа
5.	Тема 5. Методы воздействия на риски организации	2	5	подготовка к контрольной работе	18	контрольная работа
	Итого				70	

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. Встречи с представителями российских и зарубежных компаний.

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 рисков (в разрезе стран, отраслей, видов 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/ущерб).
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:

- Риск-анализ в экономике, Тихомиров, Николай Петрович;Тихомирова, Татьяна Михайловна, 2010г.
- Оценка и прогнозирование рисков в кластерной модели регионального развития, Ханнанова, Рузиля Тимербаевна, 2012г.
- Экономические и финансовые риски, Шапкин, Александр Сергеевич;Шапкин, Виктор Александрович, 2013г.
- Управление экономическим риском, Качалов, Роман Михайлович, 2012г.
- Анализ эффективности и рисков предпринимательской деятельности, Савицкая, Глафира Викентьевна, 2011г.
- Контроллинг рисков, Якупова, Наиля Маликовна;Магомедова, Зарема Ибрагимовна, 2010г.
- Введение в анализ предпринимательских рисков и проектный анализ, Сафина, Г. Р., 2010г.
- Основы анализа эффективности и рисков целевых программ, Ильичев, Алексей Васильевич, 2009г.
- Анализ надежности и рисков в кредитных организациях в условиях мирового финансового кризиса, Галий, Елена Анатольевна;Хуссамов, Раил Римович, 2009г.
- Управление рисками на предприятии, Васин, Сергей Михайлович;Шутов, Владимир Сергеевич, 2010г.
1. Никонов В. Управление рисками: Как больше зарабатывать и меньше терять / В.Никонов. - М.: Альпина Паблшерз, 2009. - 285с. // http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=9683&ln=ru&search_query
 2. 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

7.2. Дополнительная литература:

- Оценка кредитного риска и пути его оптимизации, Мусаева, Резеда Абдуллаязновна, 2006г.
- Управление финансовыми проектами и финансовыми рисками, Горбачев, Сергей Викторович;Тумашев, Айдар Равильевич, 2011г.
- Развитие методов управления рисками в строительстве, Берваль, Андрей Владимирович;Романова, Анна Ильинична, 2013г.
1. Крышкин О. Настольная книга по внутреннему аудиту : риски и бизнес-процессы /О. Крышкин. - М.: Альпина паблшер, 2011 // 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.: идательско-торговая корпорация "Дашков и Ко". - 420 с. // http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=7770&ln=ru&search_query

7.3. Интернет-ресурсы:

Журнал - www.in.sure.ru

Сайт - www.allinsurance.ru

сайт - www.riskmetrics.com

сайт - www.riskofficer.ru

Сайт - www.risk-academy.ru

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

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

проектор, ноутбук, компьютерный класс

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 080500.68 "Бизнес-информатика" и магистерской программе Аналитика в управлении бизнесом .

Автор(ы):

Хайруллина А.Д. _____

"__" _____ 201__ г.

Рецензент(ы):

Большов А.В. _____

"__" _____ 201__ г.