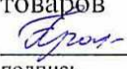



Министерство образования и науки РФ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

СОГЛАСОВАНО
Заведующий кафедрой
товароведения и экспертизы
товаров
 И.В. Кротова
подпись
« 12 » декабря 2017 г.
ТОРГОВО-ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ИНСТИТУТ
институт, реализующий ОП ВО

УТВЕРЖДАЮ
Заведующий кафедрой
менеджмента
 А.Н. Чаплина
подпись
«19» декабря 2017г.
ТОРГОВО-ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ИНСТИТУТ
институт, реализующий дисциплину

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
ТЕОРИЯ И ПРАКТИКА РИСК-МЕНЕДЖМЕНТА:
РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ В ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКОЙ
ДЕЯТЕЛЬНОСТИ**

Дисциплина Б1.В.ОД.4.1 Теория и практика риск-менеджмента: Риск-менеджмент в предпринимательской деятельности

Направление подготовки/специальность 38.04.02 Менеджмент

Направленность (профиль) 38.04.02.20 Товарный и экологический риск-менеджмент

форма обучения очная

год набора 2018

Красноярск 2017

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по укрупненной группе 380000 Экономика и управление
шифр и наименование укрупненной группы

Направления подготовки /специальность (профиль/специализация)
38.04.02 «Менеджмент»

38.04.02.20 «Товарный и экологический риск-менеджмент»
шифр и наименование магистерской программы

Программу составили канд. экон. наук, доцент И.В. Щедрина
инициалы, фамилия,



подпись

1. Цели и задачи дисциплины

1.1. *Целью* преподавания дисциплины является: изучение магистрантами теоретических положений и получение практических навыков по управлению рисками как неотъемлемыми элементами предпринимательской деятельности.

1.2. *Задачи* изучения дисциплины:

- изучение сложности и многоаспектности категории «риск» и ее использования в управлении предпринимательством;
- выявление сущности и важности исследования проблем риска;
- изучение информационной базы, общих принципов и методов, количественных и качественных подходов к анализу рисков;
- овладение современной практикой риск-менеджмента предприятий.

1.3. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы высшего образования.

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

ОК-2	
ПК-1	
ДПК-4	

- готовность действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения;
- способностью разрабатывать корпоративную стратегию, программы организационного развития и изменений и обеспечивать их реализацию;
- способность проводить анализ рыночных и специфических рисков в предпринимательской деятельности.

В результате освоения дисциплины магистранты должны обладать следующими знаниями, умениями и навыками:

Шифр	Характеристика (обязательного) порогового уровня сформированности компетенции у выпускника вуза
ОК-2	знать: социально-экономические аспекты формирования риска; уметь: измерять степень риска и возможные последствия принятых в нестандартных ситуациях решений.
ПК-2	уметь: оценивать риски при осуществлении изменений в организации; владеть: методиками разработки и реализации стратегии с учетом факторов риска.
ДПК-4	знать: виды, место и роль рисков в структуре деятельности предприятия; уметь: выделять критерии, определяющие меру риска для предприятия; проводить анализ рыночных и специфических рисков в предпринимательской деятельности; владеть: методами анализа, оценки и управления рисками.

1.4. Место дисциплины в структуре образовательной программы высшего образования.

Дисциплина входит в группу обязательных дисциплин вариативной части учебного плана.

Дисциплина изучается во втором-третьем семестрах, имеет предшествующие логические и содержательно-методические связи с дисциплинами: «Методы исследований в менеджменте», «Управление экономическими системами», «Современные проблемы менеджмента» и др.

Данная дисциплина необходима для успешного освоения дисциплин: «Современный стратегический анализ», «Экологический и товарный риск-менеджмент продовольственных и непродовольственных товаров», «Управление рисками в цепях поставок товаров», «Управление проектами» и др.

1.5. Особенности реализации дисциплины.

Дисциплина реализуется на русском языке, без применения ЭО и ДОТ.

2. Объем дисциплины

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад. часов)	Семестр 2	Семестр 3
Общая трудоемкость дисциплины	3(108)	2(72)	1(36)
Контактная работа с преподавателем:	1,0(36)	0,5 (18)	0,5 (18)
занятия лекционного типа	0,28(10)	0,17(6)	0,11(4)
занятия семинарского типа	0,72(26)	0,33(12)	0,39(14)
лабораторные работы			
другие виды контактной работы в том числе:	-	-	-
курсовая работа	-	-	-
групповые консультации	-	-	-
индивидуальные консультации	-	-	-
иные виды внеаудиторной контактной работы	-	-	-
Самостоятельная работа обучающихся:	2,0(72)	1,5(54)	0,5(18)
изучение теоретического курса (ТО)			
расчетно-графические задания, задачи (РГЗ)			
Реферат			
курсовая работа			
Вид промежуточной аттестации (зачет, экзамен)	зачет, зачет	зачет	зачет

3. Содержание дисциплины

3.1. Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий).

№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа (акад. час)	Практические занятия (акад. час)	Самостоятельная работа, (акад. час)	Формируемые компетенции
1	Инвестиционный проект как объект риск-менеджмента	2	-	4	ОК-2 ПК-2 ДПК-4
2	Планирование управления рисками	4	-	8	
3	Идентификация рисков	4	4	16	
4	Качественный анализ рисков	-	4	8	
5	Количественный анализ рисков	-	6	12	
6	Планирование реагирования на риски	-	4	8	
7	Мониторинг и управление рисками	-	8	16	
	Итого	10	26	72	

3.2. Занятия лекционного типа.

№ п/п	№ Темы дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах	
			всего	в т. ч. в инновационной форме
1		Инвестиционный проект как объект риск-менеджмента Понятие «инвестиционного проекта». Классификация инвестиционных проектов. Жизненный цикл проекта. Цели и задачи управления на фазах жизненного цикла проекта. Критерии оценки эффективности инвестиционных проектов.	2	-
2		Планирование управления рисками Определение подходов, инструментов и источников данных, которые могут использоваться для управления рисками в данном проекте. Распределение ролей и ответственности. Список позиций выполнения, поддержки и управления рисками для каждого вида операций, включенных в план управления рисками, назначение сотрудников на эти позиции и разъяснение их ответственности. Разработка бюджета. Выделение ресурсов и оценка стоимости мероприятий, необходимых для управления рисками. Определение сроков и частоты выполнения процесса управления рисками на протяжении всего жизненного цикла проекта, а также определение операций по управлению рисками, которые необходимо включить в расписание проекта	4	2

3		Идентификация рисков Определение того, какие риски могут повлиять на проект, и документальное оформление их характеристик. Структурированный анализ документации. методы сбора информации.	4	2
	Итого		10	4

3.3 Занятия семинарского типа (практические занятия)

№ п/п	№ Темы дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах	
			всего	в т. ч. в инновационной форме
1	3	Идентификация рисков Анализ контрольных списков. Анализ допущений. Диаграммы влияния	4	-
2	4	Качественный анализ рисков Расположение рисков по степени их приоритета для дальнейшего анализа или обработки путем оценки и суммирования вероятности их возникновения и воздействия на проект. Определение вероятности и воздействия рисков. Матрица вероятности и последствий. Оценка качества данных риска. Классификация рисков. Оценка срочности риска. Относительное ранжирование или список приоритетов рисков проекта.	4	4
3	5	Количественный анализ рисков Количественный анализ потенциального влияния идентифицированных рисков на общие цели проекта. Методы сбора и представления данных. Методы количественного анализа рисков и моделирования: анализ чувствительности, анализ дерева решений, моделирование и имитация. Вероятностный анализ проекта.	6	
4	6	Планирование реагирования на риски Разработка возможных вариантов и действий, способствующих повышению благоприятных возможностей и снижению угроз для достижения целей проекта. Выбор стратегии реагирования на риски. Стратегии реагирования на негативные риски (угрозы): уклонение, передача или снижение. Стратегии реагирования на позитивные риски (благоприятные возможности): использование, совместное использование, усиление. Общая стратегия реагирования на угрозы и благоприятные возможности – принятие. Стратегия реагирования на непредвиденные обстоятельства.	4	
5	7	Мониторинг и управление рисками Отслеживание идентифицированных рисков, мониторинг остаточных рисков, идентификация	8	4

	новых рисков, исполнение планов реагирования на риски и оценка их эффективности на протяжении жизненного цикла проекта. Пересмотр рисков. Аудит рисков. Анализ отклонений и трендов. Техническое измерение исполнения. Анализ резервов. Рекомендованные корректирующие действия. Активы организационного процесса (обновления)		
Итого		26	8

3.4. Лабораторные занятия

Лабораторные занятия учебным планом не предусмотрены

4. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

1. Риск-менеджмент управления проектами [Текст] : [учеб-метод. материалы к изучению дисциплины для ...38.04.02.17 Управление проектом (в том числе по отраслям)] / И.В Щедрина. – Красноярск : СФУ, 2018. – Режим доступа: <https://e.sfu-kras.ru/course/view.php?id=17000>

5. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Виды оценочных средств: кейс-задачи, тесты, зачет.

Уровень знаний, умений и навыков студентов оценивается:

оценка «зачтено» выставляется студенту при усвоении основного материала, в изложении которого допускаются отдельные неточности, нарушение последовательности, отсутствие некоторых существенных деталей, имеются затруднения в выполнении практических заданий;

оценка «не зачтено» выставляется студенту, который не владеет значительной частью материала, допускает принципиальные ошибки, с большими затруднениями выполняет практические работы, если ответ свидетельствует об отсутствии знаний по предмету.

Контрольные вопросы и задания

1. Понятие «инвестиционного проекта».
2. Классификация инвестиционных проектов.
3. Жизненный цикл проекта. Цели и задачи управления на фазах жизненного цикла проекта.
4. Критерии оценки эффективности инвестиционных проектов.
5. Распределение ролей и ответственности.
6. Разработка бюджета.
7. Выделение ресурсов и оценка стоимости мероприятий, необходимых для управления рисками.
8. Определение сроков и частоты выполнения процесса управления рисками на протяжении всего жизненного цикла проекта.
9. Какие риски могут повлиять на проект.

10. Структурированный анализ документации.
11. Методы сбора информации.
12. Анализ контрольных списков.
13. Анализ допущений.
14. Диаграммы влияния
15. Определение вероятности и воздействия рисков.
16. Матрица вероятности и последствий.
17. Оценка качества данных риска.
18. Классификация рисков.
19. Оценка срочности риска.
20. Относительное ранжирование рисков проекта.
21. Потенциальное влияние идентифицированных рисков на общие цели проекта.
22. Методы сбора и представления данных.
23. Методы количественного анализа рисков и моделирования.
24. Вероятностный анализ проекта.
25. Выбор стратегии реагирования на риски.
26. Стратегии реагирования на негативные риски (угрозы).
27. Стратегии реагирования на позитивные риски (благоприятные возможности).
28. Общая стратегия реагирования на угрозы и благоприятные возможности – принятие.
29. Стратегия реагирования на непредвиденные обстоятельства.
30. Отслеживание идентифицированных рисков.
31. Мониторинг остаточных рисков, идентификация новых рисков.
32. Оценка эффективности планов реагирования на риски на протяжении жизненного цикла проекта.
33. Аудит рисков.
34. Анализ отклонений и трендов.
35. Активы организационного процесса (обновления)

6. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины

А) основная литература

1. Управление рисками предприятия: учеб. пособие / В.Н. Уродовских. – М. : Вузовский учебник, ИНФРА-М, 2017. – 168 с.
<http://znanium.com/bookread2.php?book=615086>
2. Воробьев С.Н. Управление рисками в предпринимательстве [Электронный ресурс] / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. – 4-е изд., испр. - М. : Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2013. – 482 с.
<http://znanium.com/bookread.php?book=430664>
3. Риск-менеджмент управления проектами [Текст] : [учеб-метод. материалы к изучению дисциплины для ...38.04.02.17 Управление проектом (в том числе по отраслям)] / И.В Щедрина. – Красноярск : СФУ, 2018. –

Режим доступа: <https://e.sfu-kras.ru/course/view.php?id=17000>

4. Капустина Н. В. Развитие организации на основе риск-менеджмента: теория, методология и практика : Монография / Н. В. Капустина. – Москва : ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2014. – 178 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=494325>

5. Авдийский В.И. Риски хозяйствующих субъектов: теоретические основы, методологии анализа, прогнозирования и упр.: учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М.Безденежных. – М.: Альфа-М: НИЦ ИНФРА-М,2013. – 368 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=394136>

6. Проектирование систем управления рисками хозяйствующих субъектов : учеб. пособие / В.И. Авдийский, В.М. Безденежных, А.В. Дадалко, В.В. Земсков, Н.Г. Синявский. – М. : ИНФРА-М, 2017. – 203 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=563779>

7.

б) дополнительная литература

1. Агарков С.А. Управление рисками [Текст] : учеб. пособие для студентов вузов / С.А. Агарков, Е.С. Кузнецова. - Старый Оскол : ТНТ, 2010. - 111 с.

2. Грачева М. В. Управление рисками в инновационной деятельности [Текст] : учеб. пособие для студентов вузов / М. В. Грачева, С. Ю. Ляпина. - М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2010. - 351 с.

3. Рыхтикова Н. А. Анализ и управление рисками организации : учеб. пособие / Н.А. Рыхтикова. - 2-е изд. - М. : ФОРУМ, 2018. - 248 с. <http://znanium.com/bookread2.php?book=915955>

4. Риск-менеджмент инвестиционного проекта: учебник для студентов вузов, обучающихся по экономическим специальностям / под ред. М. В. Грачевой, А. Б. Секерина. – М.: ЮНИТИДАНА, 2012. – 544 с. <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=391215>

5. Саркисова Е. А. Риски в торговле. Управление рисками : практ. пособие / Е. А. Саркисова. - М. : Дашков и К, 2010. - 242 с.

6. Фомичев А.Н. Риск-менеджмент: учебник / А.Н. Фомичев; 3-е изд. – М. Дашков и К, 2016. – 372 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=937403>

7. Горбунов В.Л. Бизнес-планирование с оценкой рисков и эффективности проектов [Текст] : Научно-практическое пособие / В. Л. Горбунов. - 2. - Москва : Издательский Центр РИОР ; Москва : ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2018. - 287 с. – Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=924762>

8. Управление рисками организации: учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. – М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. – 153 с. Режим доступа: <http://znanium.com/bookread2.php?book=475625>

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети Интернет, необходимых для освоения дисциплины

- Научная библиотека СФУ <http://bik.sfu-kras.ru/>
- Кабинет магистра СФУ <http://master.sfu-kras.ru/>
- Бизнес-портал «Административно-управленческий портал» <http://www.aup.ru/>
- Бесплатная электронная библиотека "Экономика и управление на предприятиях: научно-образовательный портал" <http://eup.ru/>
- Интернет-проект «Корпоративный менеджмент» <http://www.cfin.ru/>

8. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Основными видами СРС в рамках изучения данной дисциплины являются

- Изучение теоретического курса, подготовка к занятиям (форма контроля – опрос в формате дискуссии);
- Подготовка письменного отчета по анализу конкретной ситуации по темам курса (форма контроля – защита отчета);
- Подготовка к сдаче зачета по дисциплине.

9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине

9.1. Перечень необходимого программного обеспечения.

Microsoft® Windows® Vista Business Russian Upgrade Academic OPEN No Level (Microsoft® Windows® XP)	Лиц сертификат 45676576, от 02.07.2009, бессрочный	Операционная система
Microsoft® Office Professional Plus 2007 Russian Academic OPEN No Level	Лиц сертификат 43164214, от 06.12.2007, бессрочный	Офисный пакет приложений, для операционных систем Microsoft Windows.
ESET NOD32 Antivirus Business Edition for 2750 users	Лиц сертификат EAV-0189835462, от 10.04.2017	Средство антивирусной защиты
Kaspersky Endpoint Security	Лиц сертификат 2462-170522081649547546 от 22.05.2017	Средство антивирусной защиты

9.2. Перечень необходимых информационных справочных систем.

- Научная библиотека СФУ <http://bik.sfu-kras.ru/>;
- Научная электронная библиотека (eLIBRARY.RU) [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://elibrary.ru/>;
- Электронная библиотека диссертаций (ЭБД) РГБ [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://diss.rsl.ru/>;
- Электронно-библиотечная система «ИНФРА-М» [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.znanium.com/>;

- Электронно-библиотечная система «Лань» [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://e.lanbook>;
- Библиографическая и реферативная база данных Scopus [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.scopus.com>;
- Поисковая платформа, объединяющая реферативные базы данных публикаций в научных журналах и патентов Web of Science [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://isiknowledge.com>;
- Справочная правовая система Консультант Плюс [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.consultant.ru/>;
- Справочная правовая система Гарант. Ру [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.garant.ru/>.

10 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине

Кафедра располагает материально-технической базой, обеспечивающей проведение всех видов дисциплинарной и междисциплинарной подготовки, практической и научно-исследовательской работы магистров, предусмотренных учебным планом подготовки и соответствующей действующим санитарным и противопожарным правилам и нормам.

В учебном процессе по дисциплине для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации используются учебные аудитории в соответствии с расписанием занятий.

Для проведения занятий лекционного типа используются наборы демонстрационного оборудования (ноутбук, экран, проектор).

Помещения для самостоятельной работы студентов оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и доступа в электронную информационно-образовательную среду университета (ЭИОС).