

14

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего профессионального образования
«Владимирский государственный университет
имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых»
(ВлГУ)



«УТВЕРЖДАЮ»

Проректор
по учебно-методической работе

А.А.Панфилов

« 12 » 02 2015 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
РУКОВОДСТВО И УПРАВЛЕНИЕ РИСКАМИ СТРОИТЕЛЬНОЙ ОРГАНИЗАЦИИ
(наименование дисциплины)

Направление подготовки 08.04.01 Строительство

Программа подготовки «Теория и практика организационно-технологических и экономических решений»

Уровень высшего образования магистратура

Форма обучения - заочная

Семестр	Трудоем- кость зач. ед, час.	Лек- ции, час.	Практич. занятия, час.	Лаборат. работы, час.	СРС, час.	Форма промежуточного контроля (экз./зачет)
4	3 ЗЕ (108ч.)	-	-	16	56	Экзамен/36
Итого	3 ЗЕ (108ч.)	-	-	16	56	Экзамен/36

Владимир 20__ г.

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целями освоения дисциплины «Руководство и управление рисками строительной организации» являются:

- снижение риска, предотвращение недопустимого риска;
- участие в разработке и реализации комплекса мероприятий операционного характера в соответствии с финансовой стратегией организации;
- планирование деятельности организации и подразделений;
- приложение теоретических положений теории риск-менеджмента в практической деятельности организаций.

Задачи дисциплины:

- изучение методологических основ принятия риск-решений;
- изучение методологии адаптивного динамического управления рисками;
- изучение принципов управления различными видами рисков;
- организация управления рисками;
- контроль деятельности подразделений, команд (групп) работников;
- мотивирование и стимулирование персонала организации, направленное на достижение стратегических и оперативных целей;
- информационно-аналитическая деятельность: сбор, обработка и анализ информации о факторах внешней и внутренней среды организации для принятия управленческих решений;
- построение внутренней информационной системы организации для сбора информации с целью принятия решений, планирования деятельности и контроля.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Дисциплина «Руководство и управление рисками строительной организации» относится к обязательным дисциплинам вариативной части, блок – Б1.

Для изучения дисциплины студент должен:

знать:

- основы менеджмента;
- систему принципов, методов и технологий управления;
- основы проектирования организационной структуры;
- определение нормативов поведения и политики фирмы в отдельных сферах её деятельности;
- технологии анализа, выработки стратегии, мотивации и контроля, маркетинга
- специфику управления нововведениями, качеством, рисками, интеллектуальным и особенно человеческим капиталом, конфликтами.

уметь:

- определять нормативы поведения и политики фирмы в отдельных сферах её деятельности;
- использовать современные методы социально-экономического анализа, идентификации и распознавания образов, информационные технологии и вычислительные средства для обоснования принятия оптимальных решений в области оценки рисков управления и бизнеса.

Дисциплина является предшествующей для научно-исследовательской работы и итоговой государственной аттестации.

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

- готовностью действовать в нестандартных ситуациях, нести социальную и этическую ответственность за принятые решения (ОК-2);
- готовностью к коммуникации в устной и письменной формах на русском и иностранном языках для решения задач профессиональной деятельности (ОПК-1);
- готовностью руководить коллективом в сфере своей профессиональной деятельности, толерантно воспринимая социальные, этнические, конфессиональные и культурные различия (ОПК-2);
- способностью использовать на практике навыки и умения в организации научно-исследовательских и научно-производственных работ, в управлении коллективом, влиять на формирование целей команды, воздействовать на ее социально-психологический климат в нужном для достижения целей направлении, оценивать качество результатов деятельности, способностью к активной социальной мобильности (ОПК-3);
- способностью анализировать технологический процесс как объект управления, вести маркетинг и подготовку бизнес-планов производственной деятельности (ПК-13);
- способностью к адаптации современных версий систем управления качеством к конкретным условиям производства на основе международных стандартов (ПК-14);
- способностью организовать работу коллектива исполнителей, принимать исполнительские решения, определять порядок выполнения работ (ПК-15)

В результате изучения дисциплины студент должен:

Знать:

- основные категории и понятия риск-менеджмента;
- виды рисков и соответствующие им методы управления;
- стратегии управления риском предприятий;
- этапы жизни и динамику рисков фирмы;
- задачи и функции управления риском.

Уметь:

- формировать активную политику риск-менеджмента на предприятии;
- использовать методы анализа и снижения «природных» рисков в практической деятельности;
- осуществлять контроль процесса управления рисками.

Владеть навыками:

- учета рисков при разработке бизнес-плана;
- методологии адаптивного динамического управления рисками;
- оценки рисков при принятии важных стратегических решений;
- методологии прогнозирования возникновения рисков ситуаций.

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных единицы, 108 часов.

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)						Объем учебной работы, с применением интерактивных методов (в часах / %)	Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра), форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	Контрольные работы	СРС	КП / КР		
1	Основные понятия и природа возникновения риска. Методы оценки, анализа и прогнозирования риска	4				1		6		-	

2	Классификация рисков. Задачи и функции управления риском.	4			2	6		1/50	
3	Риск в бизнес-планировании и бюджетировании	44			2	6		-	
4	Риск-менеджмент. Стратегия управления риском. Психологические аспекты управления рисками.	4			2	6		1/50	
5	Методы оценки, анализа и прогнозирования риска				2	6		1/50	
6	Методы и технологии идентификации стохастических рисков	4			2	6		-	
7	Управление предпринимательскими рисками	4			2	6		1/50	
8	Управление инвестиционным риском. Риск и доходность портфеля	4			2	6		1/50	
9	Управление дебиторским риском. Страхование и хеджирование	4			1	8		-	
Всего					16	56	КР	6/31	Экзамен /36

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Интерактивные образовательные технологии, используемые в аудиторных занятиях

Семестр	Вид занятия (Л, ПР, ЛР)	Используемые интерактивные образовательные технологии	Количество часов
4	ЛР	Разбор конкретных ситуаций Групповая дискуссия Постановка и решение проблем, решение логических задач	16
Итого:			16

При реализации учебной работы могут быть использованы следующие образовательные технологии: проблемные практические занятия, диалоговые практические занятия, интерактивные практические занятия, кейс-технология, деловая игра, ролевая игра, дискуссия, дебаты, мозговой штурм, проблемно-концептуальный доклад, аргументированное эссе.

Самостоятельная работа: логический анализ текстов, критический анализ текстов, формализация текстов, постановка и решение проблем, решение логических задач.

6. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ИТОГАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

6.1 Контрольные вопросы для подготовки к экзамену

1. Характеристика составляющих системы риска: собственно риск, рисковая ситуация, управление рисками, страхование рисков.
2. Современные классификации рисков и их основные проявления.
3. Организация управления риском на предприятии (схема, методы воздействия на риск).
4. Функции риск-менеджера в финансовой службе предприятия.
5. Методы оценки риска (построение деревьев событий, события – последствия, деревья отказов, индексы опасности).
6. Измерители риска (среднеквадратическая характеристика риска, диверсификация, от-

- ношение, вероятность).
7. Экономические критерии оценки эффективности управления риском.
 8. Методы управления риском (уклонение, снижение, передача, страхование).
 9. Метод «дерева решений» в управлении риском. Построение «дерева решений».
 10. Методы исследования проектных рисков.
 11. Стандартные характеристики риска: методы математической статистики (дисперсия, стандартное отклонение, коэффициент вариации), вероятность, математическое ожидание.
 12. Методы картографирования рисков: метод экспертных оценок и его сущность.
 13. Методы картографирования рисков: корректировки, несколько значений, аналогии, ставки процента с поправкой на риск.
 14. Какие задачи решаются в процессе оценки риска? В чем его отличие от этапа выявления риска?
 15. Способы снижения проектных рисков (диверсификация, распределение, страхование, резервирование, получение дополнительной информации).
 16. Риск – определение, сущность и его значение управление финансами предприятия.
 17. Варианты применения вероятностно-теоретических методов оценки риска.
 18. Сущность и характеристика инвестиционных рисков.
 19. Страхование инвестиций от финансовых и коммерческих рисков.
 20. Финансовые и коммерческие риски, их сущность и характеристика.
 21. Кредитные риски, их сущность и характеристики, способы снижения.
 22. Финансирование риска (текущий бюджет, фонды самострахования, кредитные и инвестиционные ресурсы).
 23. Процентный риск как разновидность кредитного риска, его сущность, характеристика, способы снижения.
 24. Критерии количественной оценки и основные методы количественного анализа предпринимательского риска.
 25. Основы количественного анализа инвестиционного риска.
 26. Характеристика основных проявлений банковских рисков: кредитного, процентного, депозитного и валютного.
 27. Оценка экономической эффективности страхования инвестиционных рисков.
 28. Экономическая сущность дебиторного риска. Инструменты страхования дебиторного риска (аккредитив, документарное инкассо, банковские гарантии).
 29. Функции сторон аккредитивной операции (банка-издателя, бенефициара по аккредитиву).
 30. Роль банков в аккредитивной операции: страхования дебиторных рисков авизирующего (нотифицирующего), подтверждающего, рамбурсирующего, неогоцирующего.
 31. Алгоритм платежа через документарный аккредитив.
 32. Документарное инкассо. Экономическая сущность при страховании дебиторного риска. Участвующие стороны.
 33. Банковские гарантии и их значение при страховании дебиторного риска.
 34. Инструменты страхования дебиторного риска кредиторов. Их виды и назначение.
 35. Риск отказа от платежа.
 36. Экономическая сущность политического и трансфертного риска. Причины возникновения. Средства нейтрализации.
 37. Сущность экспортного факторинга. Услуги фактора по управлению риском.
 38. Экспортное форфейтирование. Участники и их роль в страховании от политических, дебиторных и трансфертных рисков.
 39. Государственное кредитование экспортного риска. Организационные формы такой системы страхования.
 40. Страхование экспортного риска до и после экспедиции. Гарантии экспортного риска.
 41. Риск-менеджмент (определение, задачи, стратегия, тактика, объекты и субъекты управления).
 42. Функции риск-менеджмента (прогнозирование, координация, стимулирование, ин-

туция, инсайт) управление риском как система.

43. Предпринимательские риски, их виды и причины их возникновения.

44. Страховые риски (типы, причины их возникновения, способы минимизации).

45. Технические и промышленные риски, их характеристика и методы минимизации.

46. Общая схема анализа и управления рисками. Методы воздействия на риск.

6.2 Темы для СРС

Риск и неопределенность. Функции риска в экономике. Риск и неопределенность — взаимосвязь и различие понятий. Виды рисков в работе предприятия. Риски инвестиционного проекта. Риски в строительстве. Классификация рисков. Природные и социальные риски. Функции риска в экономике.

Динамический и предметный аспекты управления рисками. Управление рисками в системе менеджмента предприятия. Управление рисками как часть управления инвестиционным проектом. Управление рисками на разных стадиях жизненного цикла проекта (динамический аспект). Управление отдельными факторами и областями риска (предметный аспект).

Сущность и методы оценки риска. Качественный анализ рисков. Методы количественной оценки риска. Анализ чувствительности показателей эффективности инвестиционного проекта.

Проверка устойчивости проекта. Разработка сценариев проекта. Разработка консервативного сценария развития проекта. Разработка оптимистического сценария развития проекта. Разработка пессимистического сценария развития проекта. Смешанные сценарии.

Точка безубыточности. Запас прочности. Точка безубыточности и запас прочности как показатель степени риска хозяйственной деятельности предприятия. Выбор наименее рискованного варианта инвестирования с учетом точки безубыточности.

Вероятностные методы оценки риска. Имитационная модель. Вероятностные критерии риска.

Построение имитационной модели. Разработка сценариев. Расчет статистических показателей (математическое ожидание, дисперсия, среднее квадратическое отклонение, коэффициент вариации). Принятие оптимального инвестиционного решения на основе рассчитанных показателей.

Принятие оптимального инвестиционного решения в условиях риска и неопределенности. Склонность инвестора к риску, ее влияние на выбор варианта инвестирования. Структура матрицы доходности и матрицы рисков.

Выбор наименее рискованного инвестиционного проекта на основе вероятностных критериев. Критерии крайнего пессимизма (критерий Вальда, критерий Сэвиджа) — сущность, методика расчета. Критерии Гурвица, Байеса, Лапласа - сущность, методика расчета. Выбор наименее рискованного инвестиционного проекта исходя из рассчитанных вероятностных критериев.

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

а) основная литература

1. Балдин К. В. 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 К°", 2013.

2. Управление проектами: фундаментальный курс [Текст] : учебник / А. В. Алешин, В. М. Аньшин, К. А. Багратиони и др. ; под ред. В. М. Аньшина, О. Н. Ильиной ; Нац. исслед. ун-т "Высшая школа экономики". - М. : Изд. дом Высшей школы экономики, 2013. - 620, [4] с2.

3. Управление рисками в международном бизнесе [Электронный ресурс] : учебник / О.И. Дегтярева. - 3-е изд., стер. - М. : ФЛИНТА, 2014. - 342 с.

б) дополнительная литература

1. Антикризисное управление: Учебник / Под ред. И.К. Ларионова. - М.: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2013. - 380 с.
2. Проектный анализ и проектное финансирование / И.А. Никонова. - М.: Альпина Паблишер, 2012. - 154 с.
3. Управление рисками организации: учебное пособие / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин — М.: Издательство НИЦ ИНФРА-М, 2015. — 153 с. — (ЭБС «Знаниум»).
4. Кузьмина Н.В. Курс лекций по дисциплине "Управление рисками" / Н. В. Кузьмина, Н. В. Моргунова, Н. М. Филимонова ; Владимирский государственный университет (ВлГУ) .— Владимир : Владимирский государственный университет (ВлГУ), 2007 .— 75 с. — Имеется электронная версия .— Библиогр.: с. 73-75. ISBN 5-89368-716-7

в) рекомендуемые Интернет-ресурсы

1. www.edu.vgasu.ru
2. www.twirpx.com
3. <http://vipbook.info>

8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

- Технические и электронные средства обучения и контроля знаний студентов:
- табличный процессор Microsoft Excel,
 - текстовый редактор Microsoft Word.

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению 08.04.01 «Строительство»

Рабочую программу составил к.э.н., доц. Федоров В.В.

Рецензент (ы) ГИП ООО «Центрмонтажпроект» Сомков С.А.

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры СП
протокол № 9 от 9 февраля 2015 года.

Заведующий кафедрой _____ Ким Б.Г.

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии направления 08.04.01 «Строительство»

протокол № 6 от 12.02 2015 года.

Председатель комиссии _____ Авдеев С.Н.

