

ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель дисциплины «Управление рисками в жилищно-коммунальном хозяйстве» изучение теоретических основ и практических методов оценки и управления рисками в экономической деятельности, правилами принятия рискованных решений, методами и приемами снижения рисков в сфере ЖКХ.

Задачами курса являются:

- ознакомиться с основными понятиями и категориями рисков в управлении ЖКХ;
 - научиться применять риск-менеджмент в сфере ЖКХ;
 - знать и уметь применять методы оценки и управления рисками;
 - научиться вырабатывать решения в условиях риска и неопределенности;
 - научиться эффективно, осуществлять процессы мониторинга, управления рисками для своевременного и качественного выполнения поставленных задач;
- уметь идентифицировать риски

МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП

Дисциплина «Управление рисками в жилищно-коммунальном хозяйстве» относится к блоку дисциплин формируемых участниками образовательных отношений ОПОП магистров по направлению 38.04.10 «Жилищное хозяйство и коммунальная инфраструктура»

Пререквизиты дисциплины: дисциплина опирается на знание предметов базовой части «Социально и государственно-частное партнерство», «Управление государственным, муниципальным и частным жилым фондом».

Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) дисциплинами и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами			
Наименование обеспечивающих (предыдущих) дисциплин и обеспечиваемых (последующих) дисциплин	Разделы данной дисциплины, которые необходимы для изучения обеспечиваемых (последующих) дисциплин		
	I семестр		
	1	2	3
Предшествующие дисциплины			
1. Стратегический синергизм	+	+	+
2. Социально и государственно-частное партнерство	+	+	+
Последующие дисциплины			
1. Стратегическое управление	+	+	+
2. Управление государственным, муниципальным и частным жилым фондом	+	+	+

3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения ОПОП (компетенциями и индикаторами достижения компетенций)

Формируемые компетенции (код, содержание компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине, в соответствии с индикатором достижения компетенции		Наименование оценочного средства
	Индикатор достижения компетенции (код, содержание индикатора)	Результаты обучения по дисциплине	
ПК-1. Способен принимать управленческие решения и разрабатывать программы и мероприятия по снижению рисков, в том числе при чрезвычайных ситуациях	<p>ПК-1.1 Знает систему образования рисков.</p> <p>ПК-1.2 Умеет принимать управленческие решения и систему мероприятий по преодолению рисков и чрезвычайных ситуаций.</p> <p>ПК-1.3 Владеет навыками разработки программ и мероприятия по снижению рисков, в том числе при чрезвычайных ситуациях</p>	<p><i>Знать:</i> сущность организационно-управленческих решений в условиях риска; теоретические основы управления рисками; методы идентификации и анализа риска;</p> <p><i>Уметь:</i> находить организационно-управленческие решения, оценивать результаты и последствия принятого управленческого решения с учетом факторов риска и неопределенности; умением определять приоритеты профессиональной деятельности, разрабатывать и эффективно исполнять управленческие решения; находить, распознавать и описывать природу риска и определять его уровень; формулировать политику и составлять план риск-менеджмента в ЖКХ;</p> <p><i>Владеть:</i> навыками: применения адекватных инструментов и технологий регулирующего воздействия при реализации управленческого решения в условиях риска; навыками систематизации и обработки результатов риск-анализа; навыками определения общих намерений и направление организации по отношению к риск-менеджменту в ЖКХ</p>	Тестовые вопросы Практико-ориентированное задание

4. ОБЪЕМ И СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных единицы, 144 часов

Тематический план форма обучения – очная

№ п/п	Наименование тем и/или разделов/тем дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Контактная работа обучающихся с педагогическим работником					Самостоятельная работа	Формы текущего контроля успеваемости, форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия ¹	Лабораторные работы	в форме практической подготовки ²	Самостоятельная работа с преподавателем		
1	Тема 1. Сущность риска и неопределенности	2	1-3	3	3			3	13	
2	Тема 2. Основы построения системы факторов риска	2	4-6	3	3			3	14	Рейтинг-контроль № 1
3	Тема 3. Математические модели оценки риска	2	7-9	3	3			3	13	
4	Тема 4. Показатели оценки риска	2	10-12	3	3			3	14	Рейтинг-контроль № 2
5	Тема 5. Экспертные оценки риска	2	13-14	3	3			3	13	
6	Тема 6. Критерии принятия рискованного решения в ЖКХ	2	15-18	3	3			3	14	Рейтинг-контроль №3
Всего за 2 семестр:				18	18			18	81	Экзамен (27)
Наличие в дисциплине КП/КР										-
Итого по дисциплине				18	18			18	81	Экзамен (27)

¹ Распределение общего числа часов, указанных на практические занятия в УП, с учетом часов на КП/КР

² Данный пункт включается в рабочую программу только при формировании профессиональных компетенций.

Содержание лекционных занятий по дисциплине

Тема 1. Сущность риска и неопределенности

Основные понятия и определения. Концепция приемлемого риска. Цель и задачи риск-менеджмента. Основы теории риск-менеджмента. Природа риска. Классификации рисков.

Тема 2. Основы построения системы факторов риска

Классификационная схема видов риска в деятельности ЖКХ. Выявление факторов риска. Систематизация видов и факторов риска. Подходы к определению и классификации рисков. Идентификация рисков.

Тема 3. Математические модели оценки риска

Потери и зоны риска. Математические методы оценки риска. Количественные и качественные методы оценки риска.

Тема 4. Показатели оценки риска

Система показателей оценки риска. Абсолютные показатели оценки риска. Относительные показатели оценки риска. Вероятностные показатели оценки риска. Статистические показатели оценки риска.

Тема 5. Экспертные оценки риска

Экспертные оценки риска в принятии управленческих решений. Коллективные методы оценивания («мозговая атака», деловые игры, сценарии, совещания, «суд») — предполагают выработку общего мнения в ходе совместного обсуждения. Методы получения индивидуального мнения (анкетный опрос, метод Делфи, интервью и т.д.) — построены на индивидуальном мнении.

Тема 6. Критерии принятия рискованного решения в ЖКХ

Система критериев принятия рискованного решения. Критерии принятия решения в условиях определенности. Критерии принятия решения в условиях стохастической неопределенности.

Критерии принятия решения в условиях нестохастической неопределенности.

Содержание практических/лабораторных занятий по дисциплине

Тема 1. Сущность риска и неопределенности

Практическая работа №1. Кейс-задание: риск и неопределенность

Тема 2. Основы построения системы факторов риска

Практическая работа №2. Принятие решений и оценка риска в условиях неопределенности

Тема 3. Математические модели оценки риска

Практическая работа №3. Оценка риска инвестиционного проекта методами имитационного моделирования (метод Монте-Карло).

Тема 4. Показатели оценки риска

Практическая работа №4. Применение деревьев решений для оценки рисков

Тема 5. Экспертные оценки риска

Практическая работа №5. Экспертные оценки

Тема 6. Критерии принятия рискованного решения в ЖКХ

Практическая работа №5. Применение функций полезности Неймана-Моргенштерна для оценки рисков

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

5.1. Текущий контроль успеваемости.

1. Что является количественной мерой риска?
 - А. Вероятность события
 - Б. Ожидаемые потери
 - В. Максимальные потери
2. Какой метод позволяет идентифицировать риски?
 - А. сценарный метод
 - Б. метод анализа иерархий
 - В. метод опросного листа
3. Что позволяет определить карта рисков
 - А. Координаты рисков
 - Б. Численное значение рисков
 - В. Перечень значимых рисков
4. Какой метод количественной оценки риска позволяет моделировать стохастический характер событий?
 - А. метод Монте-Карло
 - Б. метод Делфи
 - В. SWOT анализ
5. Какой из перечисленных способов управления риском чаще всего применяется в практике риск-менеджмента?
 - А. Исключение риска
 - Б. Снижение риска
 - В. Ограничение риска

Задание к рейтинг-контролю №2

1. Какой из перечисленных механизмов управления рисками наиболее эффективен при управлении интегральным риском?
 - А. Организационный
 - Б. Инженерно-технический
 - В. Экономический
 - Г. Совместное использование перечисленных
2. Отметьте методы финансирования риска, который наиболее эффективен при высокой частоте и малых потерях.
 - А. страхование
 - Б. текущий денежный поток
 - В. государственная поддержка
3. Факторы негативного воздействия техногенных аварий включают:
 - А. барическое воздействие
 - Б. электростатическое воздействие
 - В. геомагнитное воздействие
4. Отметьте способ управления ценовым риском
 - А. долгосрочные контракты
 - Б. самострахование
 - В. создание финансовых резервов
5. Отметьте основную особенность ERM
 - А. динамический анализ рисков
 - Б. управление всей совокупностью значимых рисков
 - В. управление группой однородных рисков.

Задание к рейтинг-контролю №3

1. Страхование направлено на
 - А. снижение чрезвычайности последствий
 - Б. исключение страхуемого риска
 - В. получение прибыли
2. Основной функцией страхования является

- А. индикаторная
 - Б. предупредительная
 - В. компенсационная
3. Рисксовая надбавка учитывает
- А. величину базового тарифа
 - Б. уровень надежности страхования
 - В. величину страхуемого риска
4. Вероятность разорения применяется для
- А. Обоснования страховых тарифов
 - Б. Оценки периода функционирования страховой компании
 - В. Инициирования процедуры банкротства
5. К фундаментальным положениям и понятиям теории риск менеджмента относятся:
- А. принципы и закономерности анализа и синтеза поведения систем
 - Б. методология прогнозирования ошибок человека
 - В. организация и технология эксплуатационного взаимодействия подсистем обеспечения предпринимательской деятельности
 - Г. безотказность, долговечность и базовые характеристики их взаимозависимости
 - Д. Основные теоретические положения и понятия, сформулированные Брауном и Робертом Луссером
 - Е. нет верного ответа

5.2. Промежуточная аттестация по итогам освоения дисциплины (экзамен).

Список вопросов к экзамену

1. Понятие экономического риска.
2. Источники неопределенности, приводящие к риску.
3. Факторы, влияющие на рост степени риска.
4. Процедуры исследования риска.
5. Меры риска.
6. Понятие БДЭ и ОДО.
7. Принятие решений в условиях риска с помощью дерева решений.
8. Функция полезности и ее роль в принятии решений в условиях риска.
9. Задачи принятия решений в условиях неопределенности. Классификация видов неопределенности.
10. Модальный критерий выбора альтернатив.
11. Принятие решений в условиях противодействия. Критерии Вальда и Сэвиджа.
12. Рациональная стратегия принятия решений. Критерий Гурвица.
13. Принятие решений при отсутствии информации о состоянии внешней среды. Способ, использующий понятие Байесова множества.
14. Индивидуальный и групповой выборы.
15. Формирование функции оценки решений при групповом выборе.
16. Качественные и количественные меры риска. Среднее квадратическое отклонение значения показателя эффективности решения, как мера риска.
17. Определение оценок ОДО и БДЭ игры. Решение типичных задач.
18. Позиционные игры. Анализ и решение задач с помощью дерева решений. Обоснование выбора наиболее рациональных проектов инвестиций.
19. Аддитивная функция полезности Неймана-Моргенштерна. Построение функции полезности для выбора места работы выпускников вуза.
20. Моделирование рискованных ситуаций.
21. Исследование риска, определение мероприятий по снижению риска.
22. Выбор альтернатив на основе расчета и анализа ОДО, оценка риска.
23. Построение дерева решений, установление выигрышей и измерение риска.
24. Принятие решений на основе анализа функций полезности.

25. Принятие решений в условиях статистической неопределенности. Определение оценок по критериям Байеса и максимального правдоподобия.
26. Выбор альтернатив в соответствии с критерием Бернулли и способом, использующем понятие Байесова множества.
27. Принятие решений в условиях противодействия. Построение критериев Вальда и Сэвиджа.
28. Сущность «черного лебедя»
29. Маловероятные явления и методы реагирования на них.
30. Модель описания риска
31. Классические методы реагирования на риск
32. Методы минимизации рисков

5.3. Самостоятельная работа обучающегося.

Темы рефератов

1. Способы управления рисками на предприятиях реального сектора экономики
2. Интегральные меры риска
3. Основные методы оценки рисков
4. Анализ воздействия внешних и внутренних факторов на риски предприятия
5. Управление рыночными рисками
6. Управление операционными рисками
7. Управление производственными рисками
8. Риск-менеджмент на уровне предприятия
9. Способ расчета показателя потенциальных потерь портфеля
10. Методы расчета VaR: ковариационный (дельта-нормальный), метод исторического моделирования и метод Монте-Карло
11. Управление рисками ликвидности
12. Показатели экономического эффекта и эффективности с учетом риска: EVA (Economic Value Added — экономическая добавленная стоимость), RAROC (Risk Adjusted Return on Capital — скорректированная на риск рентабельность капитала)
13. Общие принципы и специфика управления рисками предприятия
14. Карта рисков — эффективный инструмент управления рисками
15. Анализ инвестиционных рисков методом «дерева решений»
16. Анализ инвестиционных рисков методами имитационного моделирования
17. Модели прогнозирования финансовой несостоятельности предприятия
18. Страхование риска
19. Интегрированный риск-менеджмент на уровне предприятия (ERM (Enterprise Risk Management — комплексная система управления рисками на предприятии))
20. Концепция рисковой стоимости (VaR)
21. Зарубежная практика риск-менеджмента
22. Математические методы рискового моделирования
23. Методы оценки привлекательности инвестиционного проекта
24. Диагностика банкротства предприятий
25. Методы уклонения и компенсации риска
26. Методы управления финансовым риском
27. Применение теории математических игр в риск-менеджменте
28. Процесс управления рисками на предприятии
29. Управление рисками, возникающими при лизинговом инвестировании
30. Управление производственными рисками на предприятии
31. Хеджирование рисков
32. Основные стратегии вывода предприятия из кризиса
33. Меры по восстановлению платежеспособности должника
34. Качественные и количественные методы оценки риска

Фонд оценочных материалов (ФОМ) для проведения аттестации уровня сформированности компетенций обучающихся по дисциплине оформляется отдельным документом.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1. Книгообеспеченность

Наименование литературы: автор, название, вид издания, издательство	Год издания	КНИГООБЕСПЕЧЕННОСТЬ
		Наличие в электронном каталоге ЭБС
Основная литература*		
Антонов, Г. Д. Управление рисками организации : учебник / Г.Д. Антонов, О.П. Иванова, В.М. Тумин. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 153 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — www.dx.doi.org/10.12737/textbook_593a609d7f16e7.14110373 . - ISBN 978-5-16-105840-4. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1006760	2019	https://znanium.com/catalog/product/1006760
Рыхтикова, Н. А. Анализ и управление рисками организации : учеб. пособие / Н.А. Рыхтикова. — 3-е изд. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 248 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). — www.dx.doi.org/10.12737/textbook_597f03f1c44465.44914120 . - ISBN 978-5-16-105940-1. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/991965	2019	https://znanium.com/catalog/product/991965
Уродовских, В. Н. Управление рисками предприятия : учеб. пособие / В.Н. Уродовских. — Москва : Вузовский учебник : ИНФРА-М, 2018. — 168 с. - ISBN 978-5-16-105281-5. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/937633	2018	https://znanium.com/catalog/product/937633
Дополнительная литература		
Амирова, З.Б. Управление рисками : методические рекомендации по практическим занятиям / З.Б. Амирова. — Москва : Альтаир-МГАВТ, 2019. — 28 с. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1033832	2019	https://znanium.com/catalog/product/1006760 https://znanium.com/catalog/product/1033832 2
Гуськова, Н. Д. Управление рисками энергосервисных компаний : монография / Н.Д. Гуськова, О.В. Ульянов. — Москва : ИНФРА-М, 2019. — 138 с. — (Научная мысль). — www.dx.doi.org/10.12737/monography_5b5ab497170cd9.20370203 . - ISBN 978-5-16-106885-4. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/978603	2019	https://znanium.com/catalog/product/978603
Шапкин, А. С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций: Пособие / Шапкин А.С., Шапкин В.А., - 9-е изд. - Москва : Дашков и К, 2018. - 544 с. ISBN 978-5-394-02150-3. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/339372	2018	https://znanium.com/catalog/product/937633 https://znanium.com/catalog/product/339372

6.2. Периодические издания

1. Вестник МГУ: экономика
2. Вестник Российского экономического университета им. Плеханова
3. Региональная экономика: теория и практика 2019
4. Вестник Владимирского государственного университета имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых. Серия: Экономические науки.

6.3. Интернет-ресурсы

- Еженедельник «Секрет фирмы» - www.sf-online.ru
- Еженедельник «Эксперт» - www.expert.ru

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для реализации данной дисциплины имеются специальные помещения для проведения занятий лекционного типа и занятий практического типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы. Перечень используемого лицензионного программного обеспечения: MS Windows, MS PowerPoint.

- Еженедельник «Секрет фирмы» - www.sf-online.ru
- Еженедельник «Эксперт» - www.expert.ru

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для реализации данной дисциплины имеются специальные помещения для проведения занятий лекционного типа и занятий практического типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы. Перечень используемого лицензионного программного обеспечения: MS Windows, MS PowerPoint.

Рабочую программу составил к.э.н., доцент каф. СПиУЖКК А.А. Посаженников
(ФИО, подпись)

Рецензент (представитель работодателя)
Управление ЖКХ администрации города Владимира,
заместитель начальника управления С.В. Силантьева
(место работы, должность, ФИО, подпись)

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры СПиУЖКК
Протокол № 1 от 1.09.2022 года
Заведующий кафедрой СПиУЖКК П.Н. Захаров
(ФИО, подпись)

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии
направления 38.04.10 Жилищное хозяйство и коммунальная инфраструктура
Протокол № 1 от 1.09.2022 года
Председатель комиссии П.Н. Захаров
(ФИО, подпись)

Рецензент (представитель работодателя)
Управление ЖКХ администрации города Владимира,
заместитель начальника управления П.Н. Захаров
(место работы, должность, ФИО, подпись)

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры СПиУЖКК
Протокол № 1 от 1.09.2022 года
Заведующий кафедрой СПиУЖКК П.Н. Захаров
(ФИО, подпись)

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии
направления 38.04.10 Жилищное хозяйство и коммунальная инфраструктура
Протокол № 1 от 1.09.2022 года
Председатель комиссии П.Н. Захаров
(ФИО, подпись)

**ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

Рабочая программа одобрена на 20____ / 20____ учебный года

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на 20____ / 20____ учебный года

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на 20____ / 20____ учебный года

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на 20____ / 20____ учебный года

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на 20____ / 20____ учебный года

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

