

Министерство образования и науки Республики Казахстан
Карагандинский государственный технический университет

«Утверждаю»
Председатель Ученого совета,
ректор, академик НАН РК
Газалиев А.М.

« ____ » _____ 20__ г.

ПРОГРАММА ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ СТУДЕНТА
(SYLLABUS)

Дисциплина RM 4220 «Риск-менеджмент»

Модуль RM 28 «Риск-менеджмент»

Специальность 5В050700 «Менеджмент»

Факультет инженерной экономики и менеджмента

Кафедра «Менеджмент предприятия»

Предисловие

Учебно-методический комплекс дисциплины преподавателя разработан:
ст. преподавателем кафедры Королевой Анной Алексеевной

Обсужден на заседании кафедры «Менеджмент предприятия»

Протокол № _____ от « ____ » _____ 20__ г.

Зав. кафедрой _____ Хишауева Ж.Т. « ____ » _____ 20__ г.

(подпись)

Одобен учебно-методическим советом факультета инженерной экономики и менеджмента

Протокол № _____ от « ____ » _____ 20__ г.

Председатель _____ Нурмагамбетова Н.А. « ____ » _____ 20__ г.

(подпись)

Сведения о преподавателе и контактная информация

Королева Анна Алексеевна, магистр государственного и местного управления, старший преподаватель кафедры «Менеджмент предприятия»

Кафедра «Менеджмент предприятий» находится в 4-корпусе КарГТУ (Караганда, Б.Мира 56), аудитория 224,209, контактный телефон 56-75-94 (внутренний 2036)

Трудоемкость дисциплины

Семестр	Количество кредитов / ECTS	Вид занятий					Количество часов СРС	Общее количество часов	Форма контроля
		количество контактных часов			Количество часов СРСП	всего часов			
		лекции и	практические занятия	лабораторные занятия					
7	3/5	30	15	-	45	90	45	135	Экзамен

Характеристика дисциплины

Дисциплина «Риск-менеджмент» входит в цикл базовых дисциплин, компонента по выбору.

Цель дисциплины

Дисциплина «Риск-менеджмент» имеет своей целью дать студентам представление о методологических основах управления рисками и сформировать у студентов теоретические и практические навыки управления рисками.

Задачи дисциплины:

Задачи дисциплины следующие: изучение качественных и количественных свойств экономических процессов с учётом риска;

- изучение методологии и методик построения, анализа и использования экономико-математических моделей, учитывающих риск;

- изучение типовых приёмов моделирования и измерения экономического риска в процессе принятия управленческих решений.

В результате изучения данной дисциплины студенты должны:

иметь представление о:

- отечественных и зарубежных теоретических подходах к определению понятия риска в различных сферах бизнеса;

- практике применения различных методов оценки риска в различных экономических системах и странах;

- принятых в практике способах снижения риска.

знать:

- отечественных и зарубежных теоретических подходах к определению понятия риска в различных сферах бизнеса;
- практике применения различных методов оценки риска в различных экономических системах и странах;
- принятых в практике способах снижения риска;
- основные элементы и черты риска;
- характерные виды риска для различных сфер предпринимательской деятельности;
- основные принципы и этапы процесса управления риском;
- систему количественных оценок экономического риска;

уметь:

- использовать в практике деятельности различные показатели и методы оценки риска;
- рассчитывать риск инвестиционных проектов в прикладной компьютерной программе Excel;
- применять методы хеджирования, страхования и диверсификации.

приобрести практические навыки:

- работы с учебной и научной литературой по вопросам организации, планирования и управления оценки рисков, работы с инструктивно-нормативными документами;
- в применении конкретных техник и приёмов оценки рисков.

Пререквизиты

Для изучения данной дисциплины необходимо усвоение следующих дисциплин: «Инновационный менеджмент».

Постреквизиты

Знания, полученные при изучении дисциплины «Риск-менеджмент», используются для написания дипломной работы.

Тематический план дисциплины

Наименование раздела (темы)	Трудоёмкость по видам занятий, час			
	Лекции	Практические занятия	СРСП	СРС
1. Сущность и причины неопределенности и риска. Понятие риска и управления риском. Классификация рисков.	2	1	3	3
2. Основные этапы процесса управления риском. Анализ риска. Выбор методов воздействия на риск и сравнение этих методов. Принятие решения. Непосредственное воздействие на риск.	2	1	3	3

Контроль и корректировка результатов.				
3. Методы воздействия на риск. Снижение риска. Сохранение риска. Передача риска.	2	1	3	3
4. Виды рисков. Промышленные риски. Технические риски. Экологические риски. Кредитные риски. Инвестиционные риски. Предпринимательские риски.	2	1	3	3
5. Методы выявления риска. Опросный лист. Структурные диаграммы. Карты потоков. Прямая инспекция. Анализ финансовой и управленческой отчётности.	2	1	3	3
6. Методы оценки риска. Общая схема процесса количественной оценки риска. Оценка вероятности неблагоприятных событий.	4	2	6	6
7. Метод построения деревьев событий. Метод деревьев отказов. Метод «события - последствия». Метод индексов опасностей	4	2	6	6
8. Система управления риском. Три основных принципа управления риском. Этапы управления риском	4	2	6	6
9. Финансовые риски. Методы управления финансовыми рисками	4	2	6	6
10. Предпринимательские риски	4	2	6	6
ИТОГО	30	15	45	45

Перечень практических (семинарских) занятий.

1. Сущность и причины неопределенности и риска. Понятие риска и управления риском. Классификация рисков.
2. Основные этапы процесса управления риском. Анализ риска. Выбор методов воздействия на риск и сравнение этих методов. Принятие решения. Непосредственное воздействие на риск. Контроль и корректировка результатов.
3. Методы воздействия на риск. Снижение риска. Сохранение риска. Передача риска.
4. Виды рисков. Промышленные риски. Технические риски. Экологические риски. Кредитные риски. Инвестиционные риски. Предпринимательские риски.
5. Методы выявления риска. Опросный лист. Структурные диаграммы. Карты потоков. Прямая инспекция. Анализ финансовой и управленческой отчётности.
6. Методы оценки риска. Общая схема процесса количественной оценки риска. Оценка вероятности неблагоприятных событий.
7. Метод построения деревьев событий. Метод деревьев отказов. Метод «события - последствия». Метод индексов опасностей
8. Система управления риском. Три основных принципа управления риском. Этапы управления риском
9. Финансовые риски. Методы управления финансовыми рисками
10. Предпринимательские риски

Темы контрольных заданий для СРС

1. Понятие риска и его трансформация в предпринимательстве.
2. Риск как основа создания дополнительной прибыли.
3. Факторы риска в основных видах предпринимательской деятельности.
4. Финансовые риски
5. Общая характеристика предпринимательской экономической деятельности.
6. Риски производственной деятельности.
7. Коммерческие и посреднические риски.
8. Методы идентификации поведенческих рисков.
9. Методы и технологии идентификации рисков неуставленной природы.
10. Объективные и субъективные критерии оценки стохастического риска.
11. Математические модели и методы обоснования рискованных предпринимательских решений в различных сферах деятельности.
12. Модели для расчёта показателей риска банкротства и невозврата кредита.
13. Классификация рисков по масштабам, формам и обстоятельствам их проявления.
14. Системная классификация рисков по природе формирующих их факторов.
15. Оценка рисков на основе принципа опоры на собственные силы.
16. Оценка рисков на основе принципов альтернативной и индивидуальной полезности.
17. Модели оценки и управления рисками при проведении торгов и аукционов.
18. Содержание основных подходов к управлению деловыми рисками.
19. Современные тенденции в управлении рисками и задача выбора стратегии.
20. Концепция адаптивного динамического управления рисками.
21. Служба риск-менеджмента.
22. Основные стратегические направления снижения риска.
23. Современные требования к спектру управленческих антирисковых действий.
24. Методы прогнозирования рисков неуставленной природы.
25. Классические и современные методы принятия управленческих решений в условиях риска неуставленной природы.
26. Методы управления рисками при подборе персонала
27. Основные технологии идентификации рисков.
28. Анализ рынка ценных бумаг как способ идентификации и прогнозирования рисков.
29. Методы оценки вероятностей случайных событий.
30. Методы и технологии измерения вероятностных характеристик случайных величин.
31. Статистический метод идентификации стохастических рисков

Критерии оценки знаний студентов

Экзаменационная оценка по дисциплине определяется как сумма максимальных показателей успеваемости по рубежным контролям (до 60%) и итоговой аттестации (экзамену) (до 40%) и составляет значение до 100%.

График выполнения и сдачи заданий по дисциплине

Вид контроля	Цель и содержание задания	Рекомендуемая литература	Продолжительность выполнения	Форма контроля	Срок сдачи	Баллы
1	2	3	4	5	6	7
Устный опрос на практическом занятии	Контроль усвоения теоретического материала	Использовать литературу, рекомендуемую для подготовки к практическим занятиям	В течение изучения курса в соответствии с расписанием занятий и учебным планом	Текущий	еженедельно	15
Решение ситуационных задач	Выявление навыков оценки проблем и умений принимать управленческие решения	Использовать литературу, рекомендуемую для подготовки к СРСП	4 недели	Текущий	5,8,11,14 недели	15
Письменная контрольная работа	Контроль полученных знаний и умения интерпретировать полученные результаты	Весь перечень основной и дополнительной литературы	4 контактных часа	Рубежный	7,14 недели	15
Выполнение тестовых заданий	Контроль усвоения теоретического материала и умения использовать его при выполнении заданий	Весь перечень основной и дополнительной литературы	3 недели	Текущий	3,8,13 недели	15
Экзамен	Проверка усвоения материала	Весь перечень основной и дополнительной	4 контактных часа	Итоговый	В период	40

	дисциплины	й литературы			сессии	
Итого						100

Политика и процедуры

При изучении дисциплины «Риск-менеджмент» рекомендуется соблюдать следующие правила:

1. Не опаздывать на занятия.
2. Не пропускать занятия без уважительной причины, в случае болезни прошу представить справку, в других случаях – объяснительную записку.
3. В обязанности студента входит посещение всех видов занятий.
4. Согласно календарному графику учебного процесса сдавать все виды контроля.
5. Пропущенные практические занятия отрабатывать в указанное преподавателем время.
6. Пропущенные лекционные занятия (независимо от причины) отрабатывать в виде реферата по пропущенной тематике.
7. Активно участвовать в учебном процессе.
8. Быть терпимыми, открытыми, откровенными и доброжелательными к сокурсникам и преподавателям.

Список основной литературы:

1. Балдин К.В. Риск-менеджмент: учебное пособие – М.: Эксмо, 2006. – 368с.
2. Балдин К.В. Управление рисками: Учеб. пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления / К.В. Балдин, С.Н. Воробьев. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2005. – 511 с.
3. Воробьев С.Н., Балдин К.В. Управление рисками в предпринимательстве.- М.: «Дашков и К», 2008.- 772с.
4. Дубров А.М., Лагоша Б.А., Хрусталеv Е.Ю. Моделирование рисковvх ситуаций в экономике и бизнесе: Учеб. пособие/ Под ред. Б.А. Лагоши. – М.: Финансы и статистика, 2000. – 224с.
5. Ермасов Н.Б. Риск-менеджмент организации: учебно-практическое пособие – М.: Изд.-торг. Корпорация «Дашков и К», 2008. – 380с.
6. Иванов С.С. и др. Теория и практика рискового страхования. – М.: РОСНО: Анкил, 2007. – 480с.
7. Математические методы риск-менеджмента [Текст] : учебное пособие / А. С. Долматов. - М. : Экзамен, 2007. - 319 с.
8. Общая теория рисков [Текст] : учеб. пособие для студентов высших учебных заведений, обучающихся по специальности "Менеджмент организации" / Я. Д. Вишняков, Н. Н. Радаев ; УМО по образованию в области менеджмента . - М. : Издат. центр "Академия", 2007. - 362 с.

9. Пикфорд Д. Управление рисками. – М.: ООО «Вершина», 2004 – 352с.
10. Риск-менеджмент [Текст] : учеб. пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности "Менеджмент организаций" / К. В. Балдин ; УМО вузов России по образованию в области менеджмента. - М. : Эксмо, 2006. - 368 с.
11. Риск-менеджмент [Текст] : учеб. пособие для студентов экономических специальностей очной, заочной и дистанционной форм обучения / Л. П. Гончаренко, С. А. Филин ; под ред. Е. А. Олейникова ; Рос. эконом. акад. им. Г.В. Плеханова. - 2-е изд., стер. - М. : КноРус, 2007. - 215 с.
12. Риск-менеджмент [Текст] : учебное пособие предназначено для студентов, магистрантов, докторантов в области экономики / Г. К. Кишибекова ; Казахский экономический университет им. Т. Рыскулова. - Алматы : Lem, 2014. - 304 с.
13. Риск-менеджмент в денежно-кредитной и инвестиционной деятельности: теория, мировой опыт и практика Казахстана [Текст] : учебное пособие для студентов экономических специальностей вузов / А. Д. Челекбай ; Казахский экономический университет им. Т. Рыскулова. - Алматы : Экономика, 2007. - 312 с.
14. Ступаков В.С., Токаренко Г.С. Риск-менеджмент. – М.: Финансы и статистика, 2005 – 288с.
15. Шапкин А.С. Теория риска и моделирование рискованных ситуаций: Учебник / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. – 5-е изд. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К», 2012. – 880 с.

Список дополнительной литературы

1. Баллод Б.А. Методы и алгоритмы принятия решений в экономике: учеб. пособие / Б.А. Баллод, Н.Н. Елизарова. – М.: Финансы и статистика; ИНФРА-М, 2009. – 224 с.
2. Банковский актуариат и риск-менеджмент [Текст] : научное издание для аспирантов и преподавателей / В. В. Кургузов. - М. : Финансы и статистика, 2011. - 367 с.
3. Попович В.М., Степаненко А.И. Управление кредитными рисками заёмщика, кредиторов, страхователя. – К.: Правові Джерела.
4. Райзберг Б.А. Предпринимательство и риск. – М.: Знание, 1992.
5. Риски в современном бизнесе/Грабовый П.Г., Петрова С.П., Полтавцев С.И. и др. – М.: Изд-во «Алане», 1994.
6. Салий В.В. Риск в коммерческой деятельности. Лекции для студентов – Новосибирск: СибУПК, 1997 – 30 с.
7. Севрук В.Т. Банковские риски. – М.: Изд-во «Дело», 1995.
8. Шевелев А.Е., Шевелева Е.В. Риски в бухгалтерском учете: учебное пособие – М.: Изд. Кнорус, 2007. – 304с.

**ПРОГРАММА ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ ДЛЯ СТУДЕНТА
(SYLLABUS)**

по дисциплине RM 4220 «Риск-менеджмент»

Модуль RM 28 «Риск-менеджмент»

Гос. изд. лиц. № 50 от 31.03. 2004 г.

Подписано к печати _____ 20__ г. Формат 90x60/16. Тираж _____ экз.

Объем _____ уч.изд.л. Заказ № _____ Цена договорная

100027. Издательство КарГТУ, Караганда, Бульвар Мира, 56