

**Государственное образовательное бюджетное учреждение высшего
профессионального образования**

**«ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ -
ВЫСШАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ»**

Высшая школа управления проектами

УТВЕРЖДЕНА

Директор Высшей школы
управления проектами

_____ В.М.Аньшин

«__»_____ 2013 г.

Программа учебной дисциплины

«Моделирование рисков проекта»

**для слушателей дополнительной профессиональной образовательной
программы «Мастер делового администрирования –
Master of Business Administration (MBA)»**

Автор: Габриелов Александр Олегович a.gabrielov@gmail.com

1. Пояснительная записка

1.1. Краткая характеристика учебной дисциплины (курса).

Успешная реализация инвестиционных проектов невозможна без продуманного и обоснованного управления рисками, влияние которых ставит под угрозу достижение целей любого проекта. Кроме того, в условиях экономической нестабильности все сложнее становится привлечение средств для осуществления инвестиций, что обуславливает необходимость более тщательного обоснования проектов, в том числе в области оценки и управления рисками. Курс носит теоретико-методический и инструментальный характер и направлен на создание теоретических и практических знаний в области моделирования рисков проекта.

Цель курса - сформировать у слушателей необходимый объем фундаментальных и прикладных знаний, практических навыков, необходимых для проведения работ по количественной оценке рисков инвестиционных проектов, как со стороны руководства проекта, так и с точки зрения потенциальных инвесторов и кредиторов.

Целевая аудитория данной дисциплины – слушатели системы бизнес-образования, имеющие опыт практической работы и обучающиеся по дополнительной профессиональной образовательной программе «Мастер делового администрирования – Master of Business Administration (MBA)».

Особенностью данной дисциплины является акцентом на практическом применении теоретических знаний и навыков, полученных как в ходе данного курса, так и в рамках изучения смежных дисциплин. Особое внимание уделяется использованию информационных технологий – как стандартных средств (MS EXCEL), так и специализированных программных продуктов (Oracle Crystal Ball, Primavera Risk Analysis, @Risk) – для моделирования рисков проекта.

После изучения курса слушатели будут **знать**:

- основные подходы к моделированию рисков проекта;
- основные принципы моделирования рисков проекта;
- этапы проведения имитационного моделирования рисков проекта;
- основные возможности специализированных программных продуктов в области моделирования рисков проекта.

Слушатели будут **уметь**:

- определять наиболее подходящие методы и модели количественной оценки различных рисков инвестиционных проектов;
- выбирать и осуществлять расчет ключевых показателей риска для различных типов проектов;
- использовать специализированное программное обеспечение в ходе количественной оценки рисков;
- осуществлять оценку эффективности мероприятий по реагированию на риски проекта.

1.2. Взаимосвязь данной дисциплины с другими дисциплинами.

Освоению данной дисциплины должно предшествовать изучение курсов «Основы управления проектами», «Количественные методы в менеджменте», «Принятие управленческих решений», «Инвестиционный анализ», «Управление рисками проекта».

1.3. Возможность использования полученных знаний в решении конкретных проблем, возникающих в практической деятельности

В результате изучения данной дисциплины слушатели получают представление о процессе управления рисками проекта, его организации и месте в системе управления проектом; знания о методах и моделях идентификации и оценки рисков, о подходах и инструментах управления рисками.

Слушатели получают навыки моделирования рисков проекта, которые позволят:

- повысить точность и обоснованность количественных оценок рисков;
- осуществлять обоснованный выбор мероприятий по управлению рисками и оценивать их эффективность;
- повысить эффективность принимаемых инвестиционных и управленческих решений.

2. Тематический план программы учебной дисциплины (курса) с указанием видов занятий и объема часов по каждой теме

№	Наименование темы	Аудиторные часы			Самостоятельная работа	Всего часов
		лекции	семинары	всего		
1.	Введение в моделирование рисков проекта	3	-	3	3	6
2.	Количественная оценка рисков в MS EXCEL. Анализ чувствительности. Сценарный анализ	4	4	8	3	11
3.	Оценка рисков с использованием имитационного моделирования. Моделирование рисков на основе финансовой модели проекты в Crystal Ball	4	4	8	3	11
4.	Моделирование рисков на основе сетевой модели проекта в Primavera Risk Analysis	3	2	5	3	8
ИТОГО		14	10	24	12	36

3. Формы контроля знаний, система оценки обучающихся и структура итоговой оценки

Итоговый контроль – экзамен. Итоговая оценка по учебной дисциплине складывается из следующих элементов:

- экзамен (120 мин., решение бизнес-кейса по моделированию рисков проекта с использованием специального программного обеспечения; решенный кейс сдается в электронном виде) - 100% оценки по 5 и 10 балльной шкалам.

4. Самостоятельная (внеаудиторная) работа

Разделы и темы для самостоятельного изучения	Виды и содержание самостоятельной работы
Введение в моделирование рисков проекта	Работа с литературой по теме
Количественная оценка рисков в MS EXCEL. Анализ чувствительности. Сценарный анализ	Решение бизнес-кейса
Оценка рисков с использованием имитационного моделирования. Моделирование рисков на основе финансовой модели проекты в Crystal Ball	Решение бизнес-кейса
Моделирование рисков на основе сетевой модели проекта в Primavera Risk Analysis	Решение бизнес-кейса

5. Базовая литература

1. Риск-менеджмент инвестиционного проекта. Под ред. М.В. Грачевой и А.Б. Секерина. – М.: ЮНИТИ, 2009
2. Руководство к своду знаний по управлению проектами (PMBOK), 4-е издание. PMI, 2008
3. Энциклопедия финансового риск-менеджмента / Под ред. А. А. Лобанова, А. В. Чугунова. М.: Альпина Бизнес Букс, 2009
4. Chapman R.J. Tools and techniques of enterprise risk management. Second Edition. Wiley Finance Series, 2011
5. Charnes J.M. Financial modeling with Crystal Ball and Excel. John Wiley&Sons, New Jersey, 2007
6. Copeland T., Antikarov V. Real Options. A Practitioner's Guide. Thompson Texere, 2003

7. Mun J. Modeling Risk: Applying Monte Carlo Risk Simulation, Strategic Real Options, Stochastic Forecasting, and Portfolio Optimization. John Wiley & Sons, 2010
8. Risk management – Risk assessment techniques. ISO/IEC 31010:2009
9. The Practice Standard for Project Risk Management. PMI, 2009
10. Vose D. Risk analysis: A Quantitative Guide. John Wiley & Sons, 2008
11. Интернет-страница программы Crystal Ball на сайте Oracle:
www.oracle.com/products/applications/crystalball
12. Интернет-страница программы Primavera Risk Analysis на сайте Oracle:
www.oracle.com/products/applications/primavera/risk-analysis

6. Материально-техническое и информационное обеспечение дисциплины (курса)

- LCD проектор — лекции и дискуссии в аудитории
- компьютеры и специализированное программное обеспечение (Oracle Crystal Ball, Primavera Risk Analysis) — работа в компьютерном классе

Автор программы: _____ / А.О. Габриелов/