

# УПРАВЛЕНИЕ ЭКОНОМИЧЕСКИМИ И ПРОИЗВОДСТВЕННЫМИ РИСКАМИ

## 1. Цель освоения дисциплины

Приобретение студентами теоретических знаний и практических навыков в области управления рисками, которые позволят им принимать эффективные управленческие решения.

## 2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Управление экономическими и производственными рисками» относится к вариативной части блока дисциплин и является дисциплиной по выбору.

Для освоения дисциплины «Управление экономическими и производственными рисками» обучающиеся используют знания, умения, способы деятельности и установки, сформированные в ходе изучения дисциплин «Бухгалтерский учет», «Деньги, кредит, банки», «Маркетинг», «Менеджмент», «Мировая экономика и международные экономические отношения», «Финансы», «Внешекономическая деятельность предприятий».

## 3. Планируемые результаты обучения

В результате освоения дисциплины выпускник должен обладать следующими компетенциями:

– способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет (ПК-7).

**В результате изучения дисциплины обучающийся должен:**

### *знать*

- основные понятия и содержания процесса управления рисками на предприятии;
- способы управления рисками;
- внешние и внутренние рисками компании;
- актуальные математические способы управления рисками;

### *уметь*

- использовать знания о процессе управления рисками в профессиональной деятельности;
- применять современные способы управления рисками;
- определять риски компании;
- применять различные виды анализа для оценки риска;

### *владеть*

- современными теориями управления рисками;
- методами управления рисками;
- методами мониторинга рисков;
- методами математического исследования потенциальных рисков.

## 4. Общая трудоёмкость дисциплины и её распределение

количество зачётных единиц – 3,

общая трудоёмкость дисциплины в часах – 108 ч. (в т. ч. аудиторных часов – 56 ч., СРС – 52 ч.),

распределение по семестрам – 8,

форма и место отчётности – аттестация с оценкой (8 семестр).

## **5. Краткое содержание дисциплины**

Сущность и содержания управления рисками.

Предмет управления рисками. Понятие риска и риск-менеджмента. Место курса в системе наук управления. Природа риска. Развитие взглядов на риски. Вклад Блеза Паскаля, Даниила и Якоба Бернулли, Джозефа фон Неймана, Гарри Марковица. Аспекты риска. Основные виды рисков. Стратегические, операционные (функциональные), финансовые риски и риски опасностей.

Задачи и процесс управления рисками..

Развитие взглядов на управление риском. Способы управления рисками. Страхование, резервирование, хеджирование, распределение, диверсификация, минимизация, избегание. Инструменты манипулирования рисками. Передача риска третьей стороне, самостоятельное удержание риска. Издержки и доходы управления риском. Подверженность риску. Чистый ущерб, вследствие проявления риска. Декомпозиция и регирование риска

Риски и неопределенность. Риски и стратегия..

Стратегия: внешние и внутренние риски компании. Стратегические риски компании. Риски среды. Этапы жизни и динамика рисков компании. Новые, псевдоновые и специфические риски. Мониторинг рисков.

Математические способы управления рисками.

Базовые понятия теории вероятностей и математической статистики в области рисков, финансовой математики, включая стоимость денег во времени, доходность и волатильность, методы ценообразования, волюции процентных ставок, основные виды вероятностных распределений, элементы регрессионного анализа и метод Монте-Карло.

## **6. Разработчик**

Файзулин Евгений Фаридович, ст. преподаватель кафедры менеджмента и экономики образования ФГБОУ ВО ВГСПУ.