

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Волгоградский государственный социально-педагогический университет»
Факультет управления и экономико-технологического образования
Кафедра менеджмента и экономики образования

«УТВЕРЖДАЮ»

Проректор по учебной работе

Ю. А. Жадаев

2016 г.



Управление экономическими и производственными рисками

Программа учебной дисциплины

Направление 38.03.01 «Экономика»

Профиль «Экономика предприятий и организаций»

заочная форма обучения

Волгоград
2016

Обсуждена на заседании кафедры менеджмента и экономики образования
«30» июня 2016 г., протокол № 9

Заведующий кафедрой _____ Г.И. Сидунова «30» июня 2016 г.
(подпись) (зав. кафедрой) (дата)

Рассмотрена и одобрена на заседании учёного совета факультета управления и экономико-технологического образования «29» августа 2016 г., протокол № 1

Председатель учёного совета Сидунова Г.И. _____ «29» августа 2016 г.
(подпись) (дата)

Утверждена на заседании учёного совета ФГБОУ ВО «ВГСПУ»
«29» августа 2016 г., протокол № 1

Отметки о внесении изменений в программу:

Лист изменений № <u>1</u>	_____ <u>Сидунова Г.И.</u> _____ (подпись)	_____ <u>Г.И. Сидунова</u> _____ (руководитель ОПОП)	_____ <u>19.06.2017</u> _____ (дата)
Лист изменений № _____	_____ (подпись)	_____ (руководитель ОПОП)	_____ (дата)
Лист изменений № _____	_____ (подпись)	_____ (руководитель ОПОП)	_____ (дата)

Разработчики:

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

Программа дисциплины «Управление экономическими и производственными рисками» соответствует требованиям ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» (утверждён приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12 ноября 2015 г. № 1327) и базовому учебному плану по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» (профиль «Экономика предприятий и организаций»), утверждённому Учёным советом ФГБОУ ВПО «ВГСПУ» (от 25 января 2016 г., протокол № 8).

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.

Профильной для данной дисциплины является аналитическая, научно-исследовательская профессиональная деятельность.

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

Освоение данной дисциплины является необходимой основой для последующего изучения дисциплин «Бухгалтерский учет», «Деньги, кредит, банки», «Маркетинг», «Менеджмент», «Внеэкономическая деятельность предприятий», «Корпоративные финансы», «Финансовая деятельность образовательных учреждений».

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 риски 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. Объём дисциплины и виды учебной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Семестры
		3з
Аудиторные занятия (всего)	18	18
В том числе:		
Лекции (Л)	8	8
Практические занятия (ПЗ)	10	10
Лабораторные работы (ЛР)	–	–
Самостоятельная работа	86	86
Контроль	4	4
Вид промежуточной аттестации		ЗЧО
Общая трудоемкость	часы	108
	зачётные единицы	3

5. Содержание дисциплины

5.1. Содержание разделов дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела дисциплины
1	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.
2	Задачи и процесс управления рисками.	Развитие взглядов на управление риском. Способы управления рисками. Страхование, резервирование, хеджирование, распределение, диверсификация, минимизация, избежание. Инструменты манипулирования рисками. Передача риска третьей стороне, самостоятельное удержание риска. Издержки и доходы управления риском. Подверженность риску. Чистый ущерб, вследствие проявления риска. Декомпозиция и грегирование риска
3	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.
4	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.

5.2. Количество часов и виды учебных занятий по разделам дисциплины

№ п/п	Наименование раздела дисциплины	Лекц.	Практ. зан.	Лаб. зан.	СРС	Всего
1	Сущность и содержания управления рисками	2	2	–	21	25
2	Задачи и процесс управления рисками.	2	2	–	21	25
3	Риски и неопределенность. Риски и стратегия.	2	3	–	22	27
4	Математические способы управления рисками	2	3	–	22	27

6. Перечень основной и дополнительной учебной литературы

6.1. Основная литература

1. Балдин, К. В. Управление рисками [Электронный ресурс] : учебное пособие / К. В. Балдин ; К. В. Балдин. - Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2012. - 512 с. - ISBN 5-238-00861-9. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10513>. - По паролю. - ЭБС IPRbooks..

2. Алексеенко, В. Б. Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия [Электронный ресурс] : учебно-методическое пособие / В. Б. Алексеенко, Г. М. Кутлыева, Ю. И. Мочалова ; В. Б. Алексеенко. - Москва : Российский университет дружбы народов, 2013. - 88 с. - ISBN 978-5-209-04695-0. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/22224>. - По паролю. - ЭБС IPRbooks.

6.2. Дополнительная литература

1. Никонов, В. Управление рисками [Электронный ресурс] / В. Никонов, Ю. Быстрова ; Быстрова ред. Ю. - Управление рисками ; 2017-02-15. - Москва : Альпина Паблишер, 2016. - 285 с. - ISBN 978-5-9614-1013-6. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/41476.html>. - По паролю. - ЭБС IPRbooks.

7. Ресурсы Интернета

Перечень ресурсов Интернета, необходимых для освоения дисциплины:

1. ЭБС IPRbooks (<http://www.iprbookshop.ru/>).

8. Информационные технологии и программное обеспечение

Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем (при необходимости):

1. Офисный пакет (Microsoft Office, Open Office или др.).

9. Материально-техническая база

Для проведения учебных занятий по дисциплине «Управление экономическими и производственными рисками» необходимо следующее материально-техническое обеспечение:

1. Учебные аудитории для проведения лекционных и практических занятий.
2. Комплект мультимедийного презентационного оборудования.

3. Компьютерный класс для самостоятельной работы студентов, имеющий доступ к сети Интернет.

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Дисциплина «Управление экономическими и производственными рисками» относится к вариативной части блока дисциплин и является дисциплиной по выбору. Программой дисциплины предусмотрено чтение лекций и проведение практических занятий. Промежуточная аттестация проводится в форме аттестации с оценкой.

Лекционные занятия направлены на формирование глубоких, систематизированных знаний по разделам дисциплины. В ходе лекций преподаватель раскрывает основные, наиболее сложные понятия дисциплины, а также связанные с ними теоретические и практические проблемы, даёт рекомендации по практическому освоению изучаемого материала. В целях качественного освоения лекционного материала обучающимся рекомендуется составлять конспекты лекций, использовать эти конспекты при подготовке к практическим занятиям, промежуточной и итоговой аттестации.

Практические занятия являются формой организации педагогического процесса, направленной на углубление научно-теоретических знаний и овладение методами работы, в процессе которых вырабатываются умения и навыки выполнения учебных действий в сфере изучаемой науки. Практические занятия предполагают детальное изучение обучающимися отдельных теоретических положений учебной дисциплины. В ходе практических занятий формируются умения и навыки практического применения теоретических знаний в конкретных ситуациях путем выполнения поставленных задач, развивается научное мышление и речь, осуществляется контроль учебных достижений обучающихся.

При подготовке к практическим занятиям необходимо ознакомиться с теоретическим материалом дисциплины по изучаемым темам – разобрать конспекты лекций, изучить литературу, рекомендованную преподавателем. Во время самого занятия рекомендуется активно участвовать в выполнении поставленных заданий, задавать вопросы, принимать участие в дискуссиях, аккуратно и своевременно выполнять контрольные задания.

Контроль за качеством обучения и ходом освоения дисциплины осуществляется на основе рейтинговой системы текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации студентов. Рейтинговая система предполагает 100-балльную оценку успеваемости студента по учебной дисциплине в течение семестра, 60 из которых отводится на текущий контроль, а 40 – на промежуточную аттестацию по дисциплине. Критериальная база рейтинговой оценки, типовые контрольные задания, а также методические материалы по их применению описаны в фонде оценочных средств по дисциплине, являющемся приложением к данной программе.

11. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы

Самостоятельная работа обучающихся является неотъемлемой частью процесса обучения в вузе. Правильная организация самостоятельной работы позволяет обучающимся развивать умения и навыки в усвоении и систематизации приобретаемых знаний, обеспечивает высокий уровень успеваемости в период обучения, способствует формированию навыков совершенствования профессионального мастерства.

Самостоятельная работа обучающихся во внеаудиторное время включает в себя подготовку к аудиторным занятиям, а также изучение отдельных тем, расширяющих и углубляющих представления обучающихся по разделам изучаемой дисциплины. Такая работа может предполагать проработку теоретического материала, работу с научной литературой, выполнение практических заданий, подготовку ко всем видам контрольных испытаний, выполнение творческих работ.

Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по

дисциплине представлено в рабочей программе и включает в себя:

- рекомендуемую основную и дополнительную литературу;
- информационно-справочные и образовательные ресурсы Интернета;
- оценочные средства для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации по дисциплине.

Конкретные рекомендации по планированию и проведению самостоятельной работы по дисциплине «Управление экономическими и производственными рисками» представлены в методических указаниях для обучающихся, а также в методических материалах фондов оценочных средств.

12. Фонд оценочных средств

Фонд оценочных средств, включающий перечень компетенций с указанием этапов их формирования, описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания, типовые контрольные задания и методические материалы является приложением к программе учебной дисциплины.