

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
 Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
 высшего образования
 «Заочный государственный университет им. Н.М. Федоровского»
 (ЗГУ)
 Документ подписан проставив печать
 Информация о владельце:
 ФИО: Игнатенко Виталий Иванович
 Должность: Проректор по образовательной деятельности и молодежной политике
 Дата подписания: 19.10.2023 06:22:10
 Уникальный программный ключ:
 a49ae343af5448d45d7e3e1e499659da8109ba78

УТВЕРЖДАЮ
 Проректор по ОД
 _____ Игнатенко В.И.

Управление рисками

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Экономика, менеджмент и организация производства**
 Учебный план 38.03.02_МН-20_очная форма_2020.plx
 Направление подготовки 38.03.02 Менеджмент
 Профиль подготовки Производственный менеджмент
 Квалификация **бакалавр**
 Форма обучения **очная**
 Общая трудоемкость **9 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 324
 в том числе:
 аудиторные занятия 124
 самостоятельная работа 200
 Виды контроля в семестрах:
 зачеты 7
 зачеты с оценкой 8

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	7 (4.1)		8 (4.2)		Итого	
	Неделя					
Вид занятий	уп	рп	уп	рп	уп	рп
Лекции	30	30	32	32	62	62
Практические	30	30	32	32	62	62
В том числе инт.	4				4	
Итого ауд.	60	60	64	64	124	124
Контактная работа	60	60	64	64	124	124
Сам. работа	120	120	80	80	200	200
Итого	180	180	144	144	324	324

Программу составил(и):

к.т.н., доцент Векслер Леонид Борисович _____

Рабочая программа дисциплины

Управление рисками

разработана в соответствии с ФГОС:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 МЕНЕДЖМЕНТ (уровень бакалавриата) (приказ Минобрнауки России от 12.01.2016 г. № 7)

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от г. №

Срок действия программы: уч.г.

Зав. кафедрой к.э.н., доцент А.И.Монич

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

к.э.н., доцент А.И.Монич __ _____ 2021 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2021-2022 учебном году на заседании кафедры
Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от __ _____ 2021 г. № __
Зав. кафедрой к.э.н., доцент А.И.Монич

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

к.э.н., доцент А.И.Монич __ _____ 2022 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2022-2023 учебном году на заседании кафедры
Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от __ _____ 2022 г. № __
Зав. кафедрой к.э.н., доцент А.И.Монич

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

к.э.н., доцент А.И.Монич __ _____ 2023 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2023-2024 учебном году на заседании кафедры
Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от __ _____ 2023 г. № __
Зав. кафедрой к.э.н., доцент А.И.Монич

Визирование РПД для исполнения в очередном учебном году

к.э.н., доцент А.И.Монич __ _____ 2024 г.

Рабочая программа пересмотрена, обсуждена и одобрена для
исполнения в 2024-2025 учебном году на заседании кафедры
Экономика, менеджмент и организация производства

Протокол от __ _____ 2024 г. № __
Зав. кафедрой к.э.н., доцент А.И.Монич

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	
1.1	Цели дисциплины:
1.2	• Нахождение и минимизация рисков в различных экономических ситуациях. Обеспечение непрерывности производственного процесса и стабильности деятельности компании, путем ограничения степени воздействия на деятельность компании внешних и внутренних негативных факторов.
1.3	• Расширение и углубление знаний о качественных и количественных свойствах экономических и производственных процессов с учетом риска как характерного фактора современной экономики;
1.4	• Овладение методологией и методикой построения, анализа и использования экономико-математических моделей, которые учитывают риск;
1.5	• Изучение ряда наиболее типовых приемов моделирования и измерения риска в процессе принятия решений, овладение соответствующим аппаратом с целью практического использования при решении разнообразных проблем.
1.6	Задачи дисциплины:
1.7	1. Обеспечение полного контроля над рисками за счет описания и оценки всех рисков компании, эффективной системы мониторинга рисков и своевременного выявления новых рисков.
1.8	2. Внедрение принципов учета рисков при принятии управленческих решений на основе четких процедур их выявления и оценки.
1.9	3. Анализ воздействия рисков на ключевые показатели деятельности компании, включая ее стоимость.
1.10	4. Обеспечение прогнозируемости рисков, которым подвержена компания и,
1.11	соответственно, страхование от потерь.
1.12	5. Возможная минимизация рисков и потерь при условии соблюдения экономической целесообразности.
1.13	6. Обеспечение эффективной связи между стремлением компании зарабатывать
1.14	прибыль и стремлением сделать это с минимальными потерями, т.е. обеспе-
1.15	чение оптимального сочетания доходности и риска.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП	
Цикл (раздел) ООП:	Б1.В.ДВ.11
2.1 Требования к предварительной подготовке обучающегося:	
2.1.1	Антикризисное управление
2.1.2	Инвестиционный менеджмент
2.1.3	Экономическая оценка инвестиций
2.1.4	Антикризисное управление
2.1.5	Инвестиционный менеджмент
2.1.6	Экономическая оценка инвестиций
2.2 Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	
2.2.1	Антикризисное управление
2.2.2	Инвестиционный менеджмент
2.2.3	Экономическая оценка инвестиций
2.2.4	Антикризисное управление
2.2.5	Инвестиционный менеджмент
2.2.6	Экономическая оценка инвестиций

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)	
ПК-14: умением применять основные принципы и стандарты финансового учета для формирования учетной политики и финансовой отчетности организации, навыков управления затратами и принятия решений на основе данных управленческого учета	
Знать:	
Уровень 1	основные понятия формирования финансовой политики с учетом рисков.
Уровень 2	особенности дисконтирования денежных потоков с учетом инфляции.
Уровень 3	особенности формирования стратегических решений при различных сценариях с учетом рисков.
Уметь:	
Уровень 1	составлять расчетные схемы, Уметь: принимать эффективные управленческие решения в условиях неопределенности, экстремальных ситуаций, острой конкурентной борьбы.

Уровень 2	определять точку безубыточности и финансовой устойчивости.
Уровень 3	планировать рациональные стратегии с учетом конъюнктуры рынка.
Владеть:	
Уровень 1	навыками обоснования и управления рисками; роста стоимости организации, уверенности в стабильности и предсказуемости денежных потоков и результатов деятельности компании.
Уровень 2	навыками обоснования и выбора управленческих решений.
Уровень 3	современными математическими моделями принятия управленческих решений при развитии бизнеса с учетом риска.

ПК-15: умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании

Знать:	
Уровень 1	основные концепции риск-менеджмента, особенности формирования организационных структур.
Уровень 2	основные понятия риска (рыночный, кредитный, оперативный) в экономике.
Уровень 3	методы оценки управления рисками, методы оценки инвестиционных проектов.
Уметь:	
Уровень 1	классифицировать риски, определять сущность риска.
Уровень 2	выбирать методы управления рисками, использовать методы нечетких множеств.
Уровень 3	выбирать методы управления рисками в условиях неопределенности, применять информационные нейронные системы в управленческих решениях.
Владеть:	
Уровень 1	навыками дополнительного контроля над деятельностью компании и уверенностью в отсутствии излишнего риска при принятии управленческих решений.
Уровень 2	методами снижения рисков банкротства и видения компании как надежного и эффективного инструмента вложения денежных средств;
Уровень 3	методами использования динамических моделей при оптимизации размещения финансовых средств.

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

3.1 Знать:	
3.1.1	основные понятия формирования финансовой политики с учетом рисков.
3.1.2	основные концепции риск-менеджмента, особенности формирования организационных структур.
3.2 Уметь:	
3.2.1	составлять расчетные схемы, Уметь: принимать эффективные управленческие решения в условиях неопределенности, экстремальных ситуаций, острой конкурентной борьбы.
3.2.2	классифицировать риски, определять сущность риска.
3.3 Владеть:	
3.3.1	основные понятия формирования финансовой политики с учетом рисков.
3.3.2	навыками дополнительного контроля над деятельностью компании и уверенностью в отсутствии излишнего риска при принятии управленческих решений.

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Инте пакт.	Примечание
Раздел 1. 5 семестр							
1.1	Понятие и сущность неопределенности риска. Виды рисков инвестирования /Лек/	7	10	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.2	Понятие и классификация рисков, меры оценки рисков, анализ рисков /Пр/	7	10	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.3	Понятие и классификация рисков, меры оценки рисков, анализ рисков /Ср/	7	40	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.4	Понятие и сущность неопределенности риска. Виды рисков инвестирования /Лек/	7	10	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	

1.5	Матрица выигрыша, матрица риска, понятие игры с природой, измерение инвестиционных рисков /Пр/	7	10	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.6	Матрица выигрыша, матрица риска, понятие игры с природой, измерение инвестиционных рисков /Ср/	7	40	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.7	Методы учета факторов риска и неопределенности при оценке эффективности инвестиционных проектов /Лек/	7	10	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.8	Оценка рисков в условиях полной неопределенности, критерии Вальда, Сервиджа, Гурвица. Риски при исследовании дерева решений /Пр/	7	10	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.9	Оценка рисков в условиях полной неопределенности, критерии Вальда, Сервиджа, Гурвица. Риски при исследовании дерева решений /Ср/	7	40	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.10	Многомерные статистические исследования /Лек/	8	16	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.11	Эконометрика и ее место в ряду математико-статистических и экономических дисциплин, регрессионный анализ, сущность и задачи факторного анализа, основы компонентного анализа /Пр/	8	16	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.12	Эконометрика и ее место в ряду математико-статистических и экономических дисциплин, регрессионный анализ, сущность и задачи факторного анализа, основы компонентного анализа /Ср/	8	40	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.13	Оценка инвестиционных проектов в условиях неопределенности и риска /Лек/	8	16	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.14	Классические методы оценки инвестиционных проектов: чистый дисконтированный доход, индекс рентабельности, внутренняя норма доходности, срок окупаемости. Учет вероятности и риска при классических моделях. Учет инфляции при оценке инвестиционных проектов /Пр/	8	16	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	
1.15	Классические методы оценки инвестиционных проектов: чистый дисконтированный доход, индекс рентабельности, внутренняя норма доходности, срок окупаемости. Учет вероятности и риска при классических моделях. Учет инфляции при оценке инвестиционных проектов /Ср/	8	40	ПК-14 ПК-15	Л1.1 Л1.2Л2.1	0	

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

5.1. Контрольные вопросы и задания

1. Вероятностная природа понятия рисков.
2. Измерение рисков.

3. Классификация рисков предпринимательской деятельности.
4. Понятие полной неопределенности рисков.
5. Что такое стратегические игры?
6. Определение матрицы выигрыша при игре двух лиц.
7. как находится матрица риска.
8. Что такое игра с природой?
9. Критерии оценки игр двух лиц.
10. Чем отличаются критерии максиминный, макси-макси и критерий пессимизма-оптимизма?
11. Назовите этапы создания дерева решений.
12. Выбор наиболее эффективного проекта завода различного объема производ-ства.
13. Каковы основные принципы минимизации рисков в управленческой деятель-ности?
14. Суть теории полезности и денежного эквивалента.
15. На чем базируется эконометрика?
16. В чем заключается роль эконометрики в стратегическом планировании?
17. Математические модели в эконометрике.
18. Регрессионный анализ.
19. Метод главных компонент.
20. Методы теории игр в эконометрике.
21. Математическая теория планирования эксперимента.

5.2. Темы письменных работ

5.3. Фонд оценочных средств

5.4. Перечень видов оценочных средств

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие, размещение	Издательство, год	Колич-во
Л1.1	Рогов В.А., Чудаков А.Д.	Управление рисками: допущено УМО вузов в качестве учеб. пособия для студентов вузов	Старый Оскол: ТНТ, 2015	10
Л1.2	Новиков А.И., Солодка Т.И.	Теория принятия решений и управление рисками в финансовой и налоговой сферах: учеб. пособие для бакалавров	М.: Изд.-торг. корпорация "Дашков и К", 2015	10

6.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие, размещение	Издательство, год	Колич-во
Л2.1	Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С.	Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия: учеб. пособие для вузов	М.: Изд.-торг. корпорация "Дашков и К", 2015	10

6.3.1 Перечень программного обеспечения

- 6.3.1.1 MS Windows 7 (Номер лицензии 62693665 от 19.11.2013)
- 6.3.1.2 MS Office Standard 2013 (Номер лицензии 62693665 от 19.11.2013)

6.3.2 Перечень информационных справочных систем

- 6.3.2.1 Консультант Плюс (версия для образовательных учреждений)

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1	Аудитория: 422 – мультимедийный класс (проектор в комплекте Panasonic PT-vx51; экран настенный; 1 компьютер (Intel Pentium(R) G630 2.70GHz, 2Гб ОЗУ, HDD 160 Гб) (для преподавателя))
7.2	Аудитория: 424 – компьютерный, мультимедийный класс (моноблок Acer e Machines EZ1711 – 8 комплектов+ персональный компьютер LG в комплекте (для преподавателя) (Intel Atom D525 1.80GHz, 2Гб ОЗУ, HDD 160 Гб) ; мультимедийный проектор Panasonic; экран с электроприводом настенный; интерактив-ный экран; проектор Epson EB-485Wi широко-угольный ультрокоткоф. интерактивный;))

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)