

АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

«Управление рисками на предприятии»

Дисциплина «Управление рисками на предприятии» является частью программы бакалавриата «Экономика (общий профиль, СУОС)» по направлению «38.03.01 Экономика».

Цели и задачи дисциплины

Цель учебной дисциплины - формирование комплекса знаний, умений и навыков в области управления рисками ведения хозяйственной деятельности на предприятиях машиностроения. Задачи учебной дисциплины: • изучение: видов риска; категорийно-понятийного аппарата управления рисками; методов предупреждения и снижения рисков; методов моделирования рисков, связанных с производственной деятельностью предприятий машиностроения; способов хеджирования рисков; • формирование умения: моделировать рисковые ситуации; использовать методы и инструменты управления рисками на предприятиях машиностроения; применять приемы риск-менеджмента для понижения рисков хозяйственной деятельности предприятий машиностроения; экономически оценивать изменение стоимости технологических и хозяйственных процессов под влиянием проявления рисков. • формирование навыков: анализа и разработки системы риск-менеджмента, экономической оценки влияния рисков на результаты производственной деятельности предприятия; экономической оценки результативности применения систем управления рисками..

Изучаемые объекты дисциплины

• комплекс производственных и социально-экономических рисков в хозяйственной деятельности предприятия машиностроения; • методы количественной и качественной оценки рисков; • система управления рисками на предприятии машиностроения; • методы моделирования рисков и их экономических последствий..

Объем и виды учебной работы

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах	
		Номер семестра	
		8	
1. Проведение учебных занятий (включая проведение текущего контроля успеваемости) в форме:	54	54	
1.1. Контактная аудиторная работа, из них:			
- лекции (Л)	18	18	
- лабораторные работы (ЛР)			
- практические занятия, семинары и (или) другие виды занятий семинарского типа (ПЗ)	32	32	
- контроль самостоятельной работы (КСР)	4	4	
- контрольная работа			
1.2. Самостоятельная работа студентов (СРС)	90	90	
2. Промежуточная аттестация			
Экзамен			
Дифференцированный зачет	9	9	
Зачет			
Курсовой проект (КП)			
Курсовая работа (КР)			
Общая трудоемкость дисциплины	144	144	

Краткое содержание дисциплины

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
	Л	ЛР	ПЗ	СРС
8-й семестр				

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
	Л	ЛР	ПЗ	СРС
Теоретические основы оценки и управления риском	5	0	12	36
<p>Тема 1. Теоретические основы риска как объекта управления: риск, его виды и причины возникновения; классификация рисков; объекты и субъекты риска, отношения между ними; внутренние и внешние факторы риска; виды ущерба от риска; построение моделей ситуации риска.</p> <p>Тема 2. Оценка рисков: статистические и аналитические методы оценки рисков; методы анализа финансовой устойчивости и целесообразности затрат на проект; методы экспертных оценок; метод использования аналогов; построение функций распределения при оценке рисков; моделирование поведения рискосодержащих объектов; формирование матрицы решений и оценка рискосодержащих стратегий; построение профилей рисков.</p> <p>Тема 3. Риск-менеджмент на предприятии: сущность и содержание риск-менеджмента, разработка программы действий по снижению риска; эвристические правила риск-менеджмента и их действие; коэффициент риска; организационные структуры службы риск-менеджмента; процессный подход к риск-менеджменту в организации. Внешний и внутренний мониторинг рисков; планирование в системе риск-менеджмента; понятие стратегии риск-менеджмента; основные правила стратегии риск - менеджмента и их действие; принципы и методы управления риском; средства разрешения и способы снижения риска.</p> <p>Тема 4. Комплексная система управления рисками: схематическая модель системы управления рисками на промышленном предприятии; информационная структура системы управления рисками; процедуры управления рисками в комплексной системе управления рисками.</p>				
Методы моделирования рисков	13	0	20	54
Тема 5. Моделирование рискованных ситуаций: методы формализации рисков; концепции выбора управленческих решений в условиях риска; выбор стратегии с учетом риска в форме среднеквадратического отклонения;				

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
	Л	ЛР	ПЗ	СРС
<p>моделирование рисковосодержащих событий методом Монте-Карло; использование функции ожидаемой полезности; критерии минимакса, выбора рискового варианта в условиях неопределенности в теории игр; применение процессов блуждания при моделировании экономических рисков; учет рисковых факторов при имитационном моделировании.</p> <p>Тема 6. Моделирование рисков, связанных с портфельными инвестициями: управление рисковыми портфелями; классическая теория выбора портфеля; структура портфеля рисковых ценных бумаг; допустимые и эффективные портфели; принципы выбора рискового портфеля; портфели с безрисковым активом; оценка рисков при использовании финансового рычага формирования инвестиционного портфеля; концепции рисков в моделях CAMP, SML, ATR; основы ценообразования на дисконтированные и купонные облигации; оценка процентного риска облигаций через дюрацию, эластичность и выпуклость; создание портфелей облигаций, защищенных от процентного риска; использование дюрации для прогнозирования цен облигаций; использование теории опционов для управления рисковыми инвестициями; модель цены опциона на основе стоимости эквивалентного портфеля; стоимость опциона в условиях непрерывного изменения цены базового актива; опционы и хеджирование риска изменения цен.</p> <p>Тема 7. Хеджирование рисков: основные покупатели и продавцы производных инструментов; хеджирование, его цели и принципы; формулы полного и частичного хеджирования; кросс-хеджирование; виды стратегий хеджирования; хеджирование позиций по базовым активам с помощью фьючерсных контрактов; хеджирование портфелей облигаций против процентного риска; методы использования свопов и опционов в хеджировании рисков; дельта-гамма хеджирование.</p> <p>Тема 8. Моделирование рисков, связанных с реальными инвестициями: рисконесущие факторы, влияющие на денежные потоки и</p>				

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
	Л	ЛР	ПЗ	СРС
<p>коэффициент дисконтирования; методы оценки и моделирования риска; методы анализа чувствительности инвестиционного проекта к рискам; имитационное моделирование инвестиционных проектов с помощью метода Монте-Карло; управление рисками инвестиционного проекта; экономическая оценка влияния рисков инвестиционной деятельности на развитие производства.</p> <p>Тема 9. Моделирование корпоративных рисков: производственный риск, его причины, методы его определения, моделирования и управления им; моделирование рисков неисполнения хозяйственных договоров; моделирование рисков усиления конкуренции; моделирование рисков возникновения непредвиденных расходов и сокращения доходов; риски потери имущества от предпринимательской деятельности; риски сокращения потребительского спроса; модели оценки производственных рисков и управление рисками в промышленности; экономическая оценка результатов проявления производственных рисков.</p> <p>Тема 10. Моделирование рисков внешнеэкономической деятельности: структура рисков внешнеэкономической деятельности; виды страновых рисков в международном бизнесе; факторы, определяющие страновой экономический риск; методы анализа страновых рисков; рейтинговые системы в анализе рисков (индекс BERI, рейтинг «Euromoney»); политические риски в зарубежной коммерческой деятельности и методы управления ими в международном инвестировании; риски, связанные с положениями внешнеэкономического контракта; экономическая оценка влияния рисков внешнеэкономической деятельности на результаты производства.</p>				
ИТОГО по 8-му семестру	18	0	32	90
ИТОГО по дисциплине	18	0	32	90