

АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

«Управление рисками на предприятии»

Дисциплина «Управление рисками на предприятии» является частью программы бакалавриата «Цифровая экономика и управление на предприятиях машиностроения» 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 рискованные 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 очная форма обучения

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

Вид учебной работы	Всего часов	Распределение по семестрам в часах
		Номер семестра
		8
- контрольная работа		
1.2. Самостоятельная работа студентов (СРС)	90	90
2. Промежуточная аттестация		
Экзамен		
Дифференцированный зачет	+	+
Зачет		
Курсовой проект (КП)		
Курсовая работа (КР)		
Общая трудоемкость дисциплины	144	144

Содержание дисциплины очная форма обучения

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				
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 рискменеджмента; основные правила стратегии риск - менеджмента и их действие; принципы и методы управления риском; средства разрешения и способы</p>				

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
<p>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
<p>Тема 5. Моделирование рисков ситуаций: методы формализации рисков; концепции выбора управленческих решений в условиях риска; выбор стратегии с учетом риска в форме среднеквадратического отклонения; моделирование рискосодержащих событий методом Монте-Карло; использование функции ожидаемой полезности; критерии минимакса, выбора рискованного варианта в условиях неопределенности в теории игр; применение процессов блуждания при моделировании экономических рисков; учет рисков факторов при имитационном моделировании.</p> <p>Тема 6. Моделирование рисков, связанных с портфельными инвестициями: управление рисковыми портфелями; классическая теория выбора портфеля; структура портфеля рисков ценных бумаг; допустимые и эффективные портфели; принципы выбора рискованного 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; кроссхеджирование; 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-</p>				

Наименование разделов дисциплины с кратким содержанием	Объем аудиторных занятий по видам в часах			Объем внеаудиторных занятий по видам в часах
<p>гамма хеджирование.</p> <p>Тема 8. Моделирование рисков, связанных с реальными инвестициями: рисконесущие факторы, влияющие на денежные потоки и 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. 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

Тематика примерных практических занятий

№ п.п.	Наименование темы практического (семинарского) занятия
1	Приобретение умений моделировать рисковые ситуации и оценивать ущерб от проявления риска
2	Приобретение умений оценивать риски
3	Приобретение умений разрабатывать стратегию управления рисками

4	Приобретение умений применять методы моделирования рисков
5	Приобретение умений моделировать риски в сфере управления портфельными инвестициями
6	Приобретение умений разрабатывать стратегию хеджирования риска
7	Приобретение умений моделировать риски, связанные с реальными инвестициями в машиностроении
8	Приобретение умений моделировать производственные риски в машиностроении
9	Приобретение умений моделировать риски внешнеэкономической деятельности