

Министерство образования и науки Российской Федерации
 Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
 Высшего профессионального образования
«Владимирский государственный университет
имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых»
(ВлГУ)



Проректор
по учебно-методической работе

А.А.Панфилов

« 17 » февраля 2015 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

«Оценка рисков»
 (наименование дисциплины)

Направление подготовки 38.04.02 Менеджмент

Программа подготовки "Стратегическое управление"

Уровень высшего образования Магистратура

Форма обучения Заочная

Семестр	Трудоемкость зач. ед./ час.	Лекции, час.	Практич. занятия, час.	Лаборат. работы, час.	СРС, час.	Форма промежуточного контроля (экз./зачет)
IV	2/72	-	-	10	62	Зачёт
Итого	2/72	-	-	10	62	Зачёт

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины «Оценка рисков» является формирование у магистрантов системных экономических знаний, навыков владения методами научного решения проблемных вопросов связанных с управлением рисками, достаточных для будущей профессиональной деятельности.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Курс «Оценка рисков» органически связан с рядом дисциплин управленческого характера, объектом изучения которых являются методики и практические знания в области оценки и управления рисками в процессе управления социально-экономическими системами. Курс находится в логической и содержательной взаимосвязи с такими дисциплинами как «Эффективность управления организациями», «Системное решение проблем» и предполагает наличие у студентов соответствующих знаний.

Изучение курса формирует фундамент для изучения дисциплин «Стратегический синергизм», а также при прохождении всех видов практик.

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

В результате освоения дисциплины обучающийся должен демонстрировать следующие результаты образования:	
<i>Знать:</i>	<ul style="list-style-type: none">количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения (ПК-4)
<i>Уметь:</i>	<ul style="list-style-type: none">использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения (ПК-4)
<i>Владеть:</i>	<ul style="list-style-type: none">способностью использовать количественные и качественные методы для проведения прикладных исследований и управления бизнес-процессами, готовить аналитические материалы по результатам их применения (ПК-4)

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетных единиц, 72 часа.

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Семестр	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)					Объем учебной работы, с применением интерактивных методов (в часах / %)	Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра), форма промежуточной аттестации (по семестрам)	
			Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	Контрольные работы	СРС			КП / КР
1	Теоретические основы системы рисков предпринимательской деятельности	4			1		7		0,5 часа., 50%	
2	Методические подходы к анализу рискованных ситуаций				1		7		0,5 часа., 50%	
3	Известные риски				1		7		0,5 часа., 50%	
4	Система рисков предпринимательской деятельности				1		7		0,5 часа., 50%	
5	Взаимосвязь доходности и риска				1		7		0,5 часа., 50%	
6	Методы оценки рискованных ситуаций				1		7		0,5 часа., 50%	
7	Выбор альтернативы				1		7		0,5 часа., 50%	
8	Методики оценки рисков				1		7		0,5 часа., 50%	
9	Способы разрешения рискованных ситуаций				2		6		1 час., 50%	
Всего					10		62		5 часов., 50%	Зачет

СОДЕРЖАНИЕ РАЗДЕЛОВ ДИСЦИПЛИНЫ

Перечень тем лабораторных работ

	Содержание дисциплины	Содержание лабораторных работ
1.	Теоретические основы системы рисков предпринимательской деятельности	Лабораторная работа №1 Система рисков предпринимательской деятельности
2.	Методические подходы к анализу рискованных ситуаций	
3.	Известные риски	Лабораторная работа №2 Анализ рискованных ситуаций
4.	Система рисков предпринимательской деятельности	
5.	Взаимосвязь доходности и риска	
6.	Методы оценки рискованных ситуаций	Лабораторная работа №3 Методы оценки рискованных ситуаций
7.	Выбор альтернативы	
8.	Методики оценки рисков	Лабораторная работа №4 Эффективность управления рисками
9.	Способы разрешения рискованных ситуаций	

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Освоение дисциплины предполагает использование следующих интерактивных форм проведения занятий:

- разбор конкретных ситуаций (темы 5, 9);
- деловые и ролевые игры (темы 1, 3, 6, 7);
- психологические тренинги (темы 2, 4, 8).

Удельный вес занятий, проводимых в интерактивной форме в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта составляет не менее 30% аудиторных занятий, занятия лекционного типа не превышают 50% от общей величины аудиторных занятий.

6. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ИТОГАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

Промежуточная аттестация по итогам освоения дисциплины направлена на закрепление основных элементов теоретического и практического курса. В ходе её реализации по предварительно выданным бакалаврам заданиям предусмотрены следующие формы контроля:

1. Рейтинг-контроль.
2. Решение ситуационных задач (Кейс-метод).
3. Индивидуальные и коллективные консультации по выполнению работ.
4. Выступление и оппонирование на семинарских занятиях.
5. **Зачет.**

Текущий контроль также сопровождаются участие в интерактивных играх, упражнениях, тренингах.

Самостоятельная работа студентов Темы рефератов

1. Понятие риска, его основные элементы и черты.
2. Причины возникновения экономического риска.

3. Классификация рисков.
4. Основные принципы и этапы управления риском.
5. Измерители и показатели финансовых рисков. Количественная оценка финансового риска. Оценки и измерители риска.
6. Анализ и критерии принятия решений в условиях полной неопределенности.
7. Правило Вальда.
8. Правило Сэвиджа.
9. Правило Гурвица.
10. Оптимальность по Парето.
11. Критерии принятия решений в условиях частичной неопределенности.
12. Специальные финансовые критерии риска: кредитный риск, депозитный риск, риск страхования и др.
13. Характеристики и задачи формирования портфелей ценных бумаг
14. Формирование портфеля ценных бумаг.
15. Диверсификация.
16. Рыночный (систематический) и индивидуальный (несистематический) риск ценных бумаг.
17. Измерение риска портфеля.
18. Доходность портфеля.
19. Выбор оптимального портфеля.
20. Модели оценки доходности финансовых активов
21. Портфель Марковица минимального риска.
22. Модель оценки доходности финансовых активов (САРМ).
23. Эффективность рынка.
24. Собственный риск портфеля.
25. Рыночный риск портфеля.

Промежуточная аттестация **Список вопросов к зачету**

1. Хозяйственный риск: понятие и классификация.
2. Неопределенность: понятие и виды.
3. Неопределенность и хозяйственный риск.
4. Общая характеристика хозяйственных рисков.
5. Функции хозяйственного риска.
6. Объекты, субъекты и характерные черты хозяйственного риска.
7. Риск как источник прибыли.
8. Риск и доходность.
9. Факторы риска.
10. Система рисков в хозяйственной деятельности.
11. Классификация хозяйственных рисков.
12. Производственные риски, их классификация и характеристика.
13. Финансовые риски, их классификация и характеристика.
14. Коммерческие риски, их классификация и характеристика.
15. Инвестиционные риски, их классификация и характеристика.
16. Валютные риски, их классификация и характеристика.
17. Кредитные риски, их классификация и характеристика.
18. Банковские риски, их классификация и характеристика.
19. Классификация транспортных рисков.
20. Факторы внешней среды в управлении хозяйственным риском.
21. Факторы внутренней среды в рискованной деятельности организации.
22. Среда прямого воздействия на организацию.
23. Среда косвенного воздействия на организацию.

24. Идентификация и анализ хозяйственного риска.
25. Методы выявления хозяйственных рисков: сущность и характеристика.

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

а) основная литература из библиотеки ВлГУ:

1. Управление риском в системах жизнеобеспечения городской застройки: примеры и задачи [Электронный ресурс] : учеб. пособие / Октябрьский Р.Д. - М. : Изд. дом Высшей школы экономики, 2014. - 110, с. - 300 экз. - ISBN 978-5-7598-1087-2.
2. Дегтярева О.И. Управление рисками в международном бизнесе [Электронный ресурс] : учебник / О.И. Дегтярева. - 3-е изд., стер. - М. : ФЛИНТА, 2014. - 342 с. - ISBN 978-5-9765-0156-0.
3. Комаров Е.И. Управление эффективностью социальных учреждений [Электронный ресурс]: учебно-практическое пособие/ Комаров Е.И., Стрельникова Н.Н., Малофеев И.В.— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2013.— 302 с. ISBN: 978-5-394-02081-0

б) дополнительная литература из библиотеки ВлГУ:

1. Бордовских А.Н. Политические риски международного бизнеса в условиях глобализации [Электронный ресурс] : Учеб. пособие для студентов вузов / А. Н. Бордовских. - М.: Издательство "Аспект Пресс", 2015. - 318 с. - ISBN 978-5-7567-0780-9.
2. Борзило Е.Ю. Антимонопольные риски предпринимательской деятельности [Электронный ресурс] : научно-практическое руководство / Е.Ю. Борзило - М.: Статут, 2014. - 335 с. - ISBN 978-5-8354-1020-0.
3. Купряшин Г.Л. Модернизация государственного управления. Институты и интересы [Электронный ресурс]: монография/ Купряшин Г.Л.— Электрон. текстовые данные.— М.: Московский государственный университет имени М.В. Ломоносова, 2012.— 312 с. ISBN: 978-5-211-06276-4
4. Анализ и оценка риска производственной деятельности [Электронный ресурс] : Учеб. пособие / П.П. Кукин, В.Н. Шлыков, Н.Л. Пономарев, Н.И. Сердюк. - М.: Абрис, 2012. - 327 с.: ил. - ISBN 978-5-4372-0048-3.

в) периодические издания:

1. Вестник МГУ: экономика
2. Вестник Российского экономического университета им. Плеханова
3. Региональная экономика: теория и практика
4. Инновации

г) интернет-ресурсы:

1. Еженедельник «Секрет фирмы» - www.sf-online.ru
2. Еженедельник «Эксперт» - www.expert.ru

8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

1. Поточная аудитория для лекционных занятий.
2. Иллюстративный и текстовый раздаточный материал.
3. Проектор (стационарный и переносной) с мультимедиа технологиями.
4. Флипчарт.

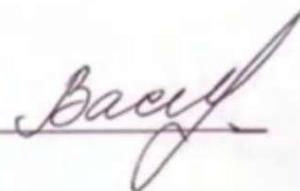
Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению 38.04.02 «Менеджмент» и программе подготовки «Стратегическое управление».

Рабочую программу составил к.э.н., доцент Посаженников А.А.



Рецензент
(представитель
работодателя)

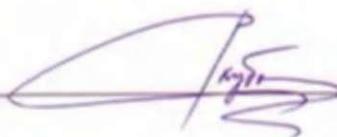
Генеральный директор
ООО «Радуга Детства»
Васькин Р.А.



Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры «Экономика и стратегическое управление»

Протокол № 31 от 21.04.2015 года.

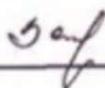
Заведующий кафедрой Скуба Р.В.



Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии направления «Менеджмент»

протокол № 5 от 21.04.2015 года.

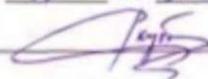
Председатель комиссии Захаров П.Н.



**ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)**

Рабочая программа одобрена на 2015-2016 учебный год

Протокол заседания кафедры № 39 от 30.06.2015 года

Заведующий кафедрой _____


Рабочая программа одобрена на 2016-2017 учебный год

Протокол заседания кафедры № 37 от 27.06.2016 года

Заведующий кафедрой _____


Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____