

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Санкт-Петербургский государственный университет промышленных технологий и дизайна»
(СПбГУПТД)

УТВЕРЖДАЮ

Первый проректор, проректор по
УР

_____ А.Е. Рудин

« 28 » 06 2022 года

Рабочая программа дисциплины

Б1.В.17

Управление экономическими и производственными рисками

Учебный план: 2022-2023 38.03.02 ВШПМ Мен в медиабиз и полигр ОО №1-1-56.plx

Кафедра: **2** Полиграфического оборудования и управления

Направление подготовки:
(специальность) 38.03.02 Менеджмент

Профиль подготовки: Менеджмент в медиабизнесе и полиграфии
(специализация)

Уровень образования: бакалавриат

Форма обучения: очная

План учебного процесса

| Семестр (курс для ЗАО) | | Контактная работа обучающихся | | Сам. работа | Контроль, час. | Трудоёмкость, ЗЕТ | Форма промежуточной аттестации |
|---------------------------|-----|----------------------------------|-------------------|----------------|-------------------|----------------------|--------------------------------------|
| | | Лекции | Практ. занятия | | | | |
| 8 | УП | 18 | 18 | 81 | 27 | 4 | Экзамен |
| | РПД | 18 | 18 | 81 | 27 | 4 | |
| Итого | УП | 18 | 18 | 81 | 27 | 4 | |
| | РПД | 18 | 18 | 81 | 27 | 4 | |

Санкт-Петербург
2022

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент, утверждённым приказом Министерства образования и науки Российской Федерации от 12.08.2020 г. № 970

Составитель (и):

кандидат экономических наук, Директор института

Тараненко
Юрьевна

Елена

От кафедры составителя:

Заведующий кафедрой полиграфического
оборудования и управления

Тараненко Елена
Юрьевна

От выпускающей кафедры:

Заведующий кафедрой

Тараненко Елена
Юрьевна

Методический отдел:

1 ВВЕДЕНИЕ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1 Цель дисциплины: Сформировать компетенции обучающегося в области изучения теории и методов управления рисками в разных сферах производственной деятельности предприятия, формирования у студентов умения распознавать экономические и производственные риски, анализировать возможные угрозы и выбирать наиболее эффективные методы и рекомендации по минимизации рисков при управлении производственными системами.

1.2 Задачи дисциплины:

- выработка представлений об экономических и производственных рисках в деятельности предприятия, сущности, особенностях, элементах и разновидностях рисков;
- выбор методов выявления риска, его оценка и определение пределов допустимого риска;
- овладение технологией применения на практике наиболее эффективных методов управления экономическими и производственными рисками предприятия.

1.3 Требования к предварительной подготовке обучающегося:

Предварительная подготовка предполагает создание основы для формирования компетенций, указанных в п. 2, при изучении дисциплин:

Компьютерный анализ инвестиционных проектов

Экономико-математические модели и методы в медиапланировании

Операционный менеджмент

2 КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

| |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ПК-6: Способен разрабатывать мероприятия по воздействию на риск в разрезе отдельных видов и проводить их экономическую оценку |
| Знать: содержание подходов к оценке рыночных, производственных и специфических рисков |
| Уметь: обосновывать принятие управленческих решений в условиях риска и неопределенности по инвестированию и финансированию |
| Владеть: навыками идентификации и управления рыночными и специфическими рисками деятельности предприятия |

3 РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

| Наименование и содержание разделов, тем и учебных занятий | Семестр (курс для ЗАО) | Контактная работа | | СР (часы) | Инновац. формы занятий | Форма текущего контроля |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|-------------------|---------------|--------------|------------------------------|-------------------------------|
| | | Лек. (часы) | Пр. (часы) | | | |
| Раздел 1. Природа риска и методы его управления | 8 | | | | | О |
| Тема 1. Риск и неопределенность. Сущность и содержание предпринимательского риска. Концепция приемлемого риска. Классификации рисков. Основные принципы классификации рисков. Общая классификация рисков. Сущность и содержание экономических рисков. Сущность и содержание производственных рисков | | 2 | 2 | 9 | | |
| Тема 2. Классификация методов управления рисками. Признаки классификации: сферам деятельности, фазам проектного цикла, видам получателей выгод. Классификация способов воздействия на риск (снижение, сохранение, передача). Дособытийные и послесобытийные мероприятия по управлению рисками. Содержание методов управления рисками: уклонение, локализация, диверсификация (диссипация), компенсация. | | 2 | 2 | 9 | ГД | |

| | | | | | |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|---|---|--|---|
| Тема 3. Концепции минимизации риска и приемлемого риска. Механизмы нейтрализации риска. Средства разрешения риска. Приемы снижения степени риска. Методы компенсации риска. Управление риском: сущность и содержание. Оперативное управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта. Управление рисками проектов долгосрочных инвестиций на основе реальных опционов. Политика управления рисками. | 2 | 2 | 9 | | |
| Раздел 2. Идентификация и анализ рисков в деятельности организации | | | | | |
| Тема 4. Система идентификации факторов риска. Процедуры анализа рисков: качественный и количественный подход. Метод экспертных оценок, SWOT-анализ, роза (звезда) и спираль рисков, метод аналогий, метод ставки процента с поправкой на риск, метод критических значений. Идентификация опасностей или инцидентов. Карта потоков производства, прямая инспекция, причинно-следственная диаграмма (диаграмма Исикавы). | 2 | 2 | 9 | | О |

| | | | | | |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|---|---|----|---|
| Тема 5. Управление экономическими и производственными рисками на основе метода анализа иерархий. Анализ иерархических систем в задачах риск - анализа. Идентификация наиболее значимых риск - факторов с помощью метода анализа иерархий | 2 | 2 | 9 | ГД | |
| Тема 6. Принятие решений в условиях риска и неопределенности. Основные понятия теории статистических решений. Принятие решений по критерию Байеса- Лапласа. Принятие решений с помощью дерева решений (позиционные или многоэтапные игры). Принятие решений в условиях полной неопределенности (игры с природой). Понятие игры с природой. Принятие решений по максиминному критерию Вальда. Принятие решений по критерию минимаксного риска Сэвиджа- Ниганса. Принятие решений по критерию пессимизма-оптимизма Гурвица. Принятие решений по критерию недостаточного основания Лапласа. | 2 | 2 | 9 | | |
| Раздел 3. Количественные методы управления рисками | | | | | |
| Тема 7. Факторы и модели оценки риска финансовой несостоятельности предприятия. Динамика развития моделей оценки риска банкротства предприятия. Дискриминантные факторные модели прогнозирования банкротства предприятия. | 2 | 2 | 9 | | О |

| | | | | | |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|----|-------|----|--|
| Тема 8. Математические модели управления экономическими и производственными рисками. Оценка рисков на основе метода «Анализ безубыточности». Механизм управления риском на основе американской модели финансового рычага. Механизм управления риском на основе европейской модели финансового рычага. Механизм комплексного управления экономическим и производственным рисками. Оценка рисков на основе метода «Анализ чувствительности». Оценка риска на основе метода «анализа сценариев». Правило «трех сигм». | 2 | 2 | 9 | ГД | |
| Тема 9. Анализ и управление рисками на основе применения статистического моделирования. Общая характеристика метода статистического (имитационного) моделирования. Основные этапы построения статистической модели исследуемого процесса. Теоретические основы метода статистических испытаний (метода Монте-Карло). Алгоритм построения и анализа имитационной модели производственной системы. Анализ риска решений с помощью метода статистических испытаний. | 2 | 2 | 9 | | |
| Итого в семестре (на курсе для ЗАО) | 18 | 18 | 81 | | |
| Консультации и промежуточная аттестация (Экзамен) | 2,5 | | 24,5 | | |
| Всего контактная работа и СР по дисциплине | 38,5 | | 105,5 | | |

4 КУРСОВОЕ ПРОЕКТИРОВАНИЕ

Курсовое проектирование учебным планом не предусмотрено

5. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

5.1 Описание показателей, критериев и системы оценивания результатов обучения

5.1.1 Показатели оценивания

| Код компетенции | Показатели оценивания результатов обучения | Наименование оценочного средства |
|-----------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------|
| ПК-6 | Объясняет основные определения и виды рисков, классифицирует методы идентификации рисков. Определяет контекст процесса оценки риска в соответствии с внутренней и внешней средой функционирования организации, а также особые обстоятельства и ограничения. Применяет современные информационно-аналитические системы для анализа и управления инвестиционными и финансовыми рисками. | Вопросы для устного собеседования Практическое задание Практическое задание |

5.1.2 Система и критерии оценивания

| Шкала оценивания | Критерии оценивания сформированности компетенций | |
|------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|
| | Устное собеседование | Письменная работа |
| 5 (отлично) | Полный, исчерпывающий ответ, явно демонстрирующий глубокое понимание предмета и широкую эрудицию в оцениваемой области, умение использовать теоретические знания для решения практических задач. | |

| | | |
|-------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|
| 4 (хорошо) | Ответ полный и правильный, основанный на проработке всех обязательных источников информации. Подход к материалу ответственный, но допущены в ответах небольшие погрешности, которые устраняются только в результате собеседования. | |
| 3 (удовлетворительно) | Ответ воспроизводит в основном только лекционные материалы, без самостоятельной работы с рекомендованной литературой. Демонстрирует понимание предмета в целом при неполных, слабо аргументированных ответах. Присутствуют неточности в ответах, пробелы в знаниях по некоторым темам, существенные ошибки, которые могут быть найдены и частично устранены в результате собеседования. | |
| 2 (неудовлетворительно) | Ответ воспроизводит в основном только лекционные материалы, без самостоятельной работы с рекомендованной литературой. Демонстрирует понимание предмета в целом при неполных, слабо аргументированных ответах. Присутствуют неточности в ответах, пробелы в знаниях по некоторым темам, существенные ошибки, которые могут быть найдены и частично устранены в результате собеседования. Непонимание заданного вопроса. Неспособность сформулировать хотя бы отдельные концепции дисциплины. Попытка списывания, использования неразрешенных технических устройств или пользования подсказкой другого | |

| | | |
|--|---------------------------------------------------------|--|
| | человека (вне зависимости от успешности такой попытки). | |
|--|---------------------------------------------------------|--|

5.2 Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности

5.2.1 Перечень контрольных вопросов

| № п/п | Формулировки вопросов |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Семестр 8 | |
| 1 | Место и роль рисков в предпринимательской деятельности. Риск и неопределенность. |
| 2 | Сущность и содержание предпринимательского риска. Концепция приемлемого риска. |
| 3 | Признаки классификации: сферам деятельности, фазам проектного цикла, видам получателей выгод |
| 4 | Содержание методов управления рисками: уклонение, локализация, диверсификация (диссипация), компенсация |
| 5 | Оперативное управление рисками долгосрочного инвестиционного проекта. |
| 6 | Управление рисками проектов долгосрочных инвестиций на основе реальных опционов |
| 7 | Процедуры анализа рисков: качественный и количественный подход |
| 8 | Метод экспертных оценок, SWOT-анализ, роза (звезда) и спираль рисков |
| 9 | Карта потоков производства, прямая инспекция, причинно-следственная диаграмма (диаграмма Исикавы) |
| 10 | Анализ иерархических систем в задачах риск - анализа |
| 11 | Идентификация наиболее значимых риск - факторов с помощью метода анализа иерархий |
| 12 | Принятие решений по критерию Байеса- Лапласа |
| 13 | Принятие решений по критерию минимаксного риска Сэвиджа- Ниганса |
| 14 | Динамика развития моделей оценки риска банкротства предприятия |
| 15 | Дискриминантные факторные модели прогнозирования банкротства предприятия |

| | |
|----|----------------------------------------------------------------------------|
| 16 | Оценка рисков на основе метода «Анализ безубыточности» |
| 17 | Механизм управления риском на основе европейской модели финансового рычага |
| 18 | Механизм комплексного управления экономическим и производственным рисками |
| 19 | Оценка рисков на основе метода «Анализ чувствительности» |
| 20 | Оценка риска на основе метода «анализа сценариев» |
| 21 | Правило «трех сигм» |
| 22 | Основные этапы построения статистической модели исследуемого процесса |
| 23 | Теоретические основы метода статистических испытаний (метода Монте-Карло) |
| 24 | Анализ риска решений с помощью метода статистических испытаний |

5.2.2 Типовые тестовые задания

5.2.3 Типовые практико-ориентированные задания (задачи, кейсы)

1. Пусть издательская фирма предполагает выйти на рынок печатной продукции. Руководство фирмы, исходя из оценок возможных состояний рынка и собственных возможностей, сформулировало три альтернативных варианта стратегии - X1, X2, X3. Проведенные маркетинговые исследования показали, что по уровню платёжеспособного спроса на издания рынок может находиться в трех различных состояниях - S1, S2, S3. Для каждой пары X_i и S_j приведены величины U_{ij} выигрыша (прибыли) фирмы. Вероятности различных состояний рынка известны. Требуется выбрать оптимальный вариант стратегии фирмы по критерию Байеса – Лапласа.

2. Фирма, специализирующаяся на проведении маркетинговых исследований, одновременно получила заказ на исследование трёх рынков - А, В, С. За каждое исследование, выполненное успешно и в срок, заказчик заплатит фирме по 200 тыс. руб. Информация о затратах, связанных с проведением исследований, и вероятностях их успешного выполнения представлена. Рынок Затраты, тыс. руб. Вероятность успеха, %, А -120-85; В-100-70; С-60-40. Фирма постарается приложить все усилия, чтобы завершить исследования в срок, однако это может оказаться невозможным по не зависящим от неё причинам. В случае невыполнения исследования в срок заказчик его не оплатит, а понесённые фирмой затраты ничем не будут компенсированы. Время и ресурсы фирмы ограничены, поэтому возможно выполнение только одного исследования.

Требуется:

1. Построить дерево решений и выбрать оптимальную стратегию фирмы, связанную с выполнением исследования определенного рынка, по критерию максимизации ожидаемой прибыли;

2. Провести анализ чувствительности дерева решений к изменению следующих факторов:

- вероятность успеха исследования рынка В;
- затраты на проведение исследования рынка В.

5.3 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, владений (навыков и (или) практического опыта деятельности)

5.3.1 Условия допуска обучающегося к промежуточной аттестации и порядок ликвидации академической задолженности

Проведение промежуточной аттестации регламентировано локальным нормативным актом СПбГУПТД «Положение о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся»

5.3.2 Форма проведения промежуточной аттестации по дисциплине

Устная Письменная Компьютерное тестирование Иная

5.3.3 Особенности проведения промежуточной аттестации по дисциплине

При проведении экзамена время, отводимое на подготовку к ответу, составляет не более 40 мин. Для выполнения практического задания, как части экзаменационного задания, обучающему необходимо иметь калькулятор, также ему предоставляется необходимая справочная информация.

Сообщение результатов обучающемуся производится непосредственно после устного ответа на вопросы и представления результатов практической части экзамена.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

6.1 Учебная литература

| Автор | Заглавие | Издательство | Год издания | Ссылка |
|------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------|------------------------|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 6.1.1 Основная учебная литература | | | | |
| Панягина, А. Е., Свистунов, А. В. | Управление рисками на предприятии: теория и практика | Москва: Ай Пи Ар Медиа | 2020 | http://www.iprbookshop.ru/96561.html |
| Балдин, К. В., Воробьев, С. Н. | Управление рисками | Москва: ЮНИТИ-ДАНА | 2017 | http://www.iprbookshop.ru/71229.html |
| 6.1.2 Дополнительная учебная литература | | | | |
| Чигиринова М. В. | Риск-менеджмент. Практические занятия. Самостоятельная работа | СПб.: СПбГУПТД | 2017 | http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=2017619 |

| | | | | |
|------------------|-------------------------------------------------------------|--------------------------|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Никонов, В. | Управление рисками: Как больше зарабатывать и меньше терять | Москва: Альпина Паблишер | 2019 | http://www.iprbookshop.ru/82360.html |
| Чигиринова М. В. | Риск-менеджмент. Самостоятельная работа. Контрольные работы | СПб.: СПбГУПТД | 2018 | http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=2018351 |

6.2 Перечень профессиональных баз данных и информационно-справочных систем

База данных Минэкономразвития РФ «Информационные системы Министерства в сети Интернет» [Электронный ресурс]. URL: <http://economy.gov.ru/minec/about/systems/infosystems/>
База открытых данных Минтруда России [Электронный ресурс]. URL: <https://rosmintrud.ru/opendata>
Федеральный образовательный портал «Экономика Социология Менеджмент» [Электронный ресурс]. URL: <http://ecsocman.hse.ru>

6.3 Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения

MicrosoftOfficeProfessional
ПП Project Expert 7 Tutorial
Audit Expert

6.4 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине

| Аудитория | Оснащение |
|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Лекционная аудитория | Мультимедийное оборудование, специализированная мебель, доска |
| Компьютерный класс | Мультимедийное оборудование, компьютерная техника с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду |