

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ
имени академика М.Д. Миллионщикова



Рабочая программа

дисциплины

«Риск-менеджмент и экономическая безопасность предприятия»

Направление подготовки

38.06.01 – Экономика

Профиль

Экономика и управление народным хозяйством (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами: промышленность)

Квалификация выпускника

Исследователь. Преподаватель-исследователь.

Грозный – 2020

1. Цели и задачи дисциплины

Цель дисциплины – формирование у аспирантов всесторонних и глубоких знаний о риск-менеджменте и экономической безопасности деятельности предприятия, а также развитие практического умения обеспечения его экономической безопасности в условиях неопределенности и построения эффективной системы риск-менеджмента.

Задачи изучения дисциплины – развитие навыков оценки уровня рисков и потенциальных экономических опасностей; практическое использование методов риск-менеджмента и экономической безопасности предприятия; использование основных положений и правил создания системы управления рисками на предприятии.

2. Место дисциплины в структуре основной профессиональной образовательной программы

Дисциплина «Риск-менеджмент и экономическая безопасность деятельности предприятия» является дисциплиной по выбору вариативной части учебного плана.

Для изучения данной дисциплины необходимо освоение курсов «Теоретико-методологические основы функционирования промышленных систем», «Теоретические и методологические принципы формирования систем менеджмента».

В свою очередь, данная дисциплина, помимо самостоятельного значения, является предшествующей для курса «Экономика и управление народным хозяйством (экономика, организация и управление предприятиями, отраслями, комплексами: промышленность)» и выполнения научных исследований.

3. Требования к результатам освоения дисциплины

В результате освоения образовательной программы выпускник должен обладать следующими профессиональными компетенциями:

- способностью ориентироваться в разнообразии теоретических и методологических подходов к фундаментальным исследованиям проблем становления и развития теории и практики управления организациями как социальными и экономическими системами, полученные отечественными и зарубежными исследователями, обосновывать актуальность, теоретическую и практическую значимость избранной темы научного исследования (ПК-1);

- способностью разрабатывать оптимальные решения в области планирования, организации и управления деятельностью промышленных предприятий, отраслей, комплексов, эффективностью использования материальных, информационных, финансовых, человеческих и производственных ресурсов с целью их рационализации (ПК-2);

- способностью самостоятельно спланировать и организовать проведение научного исследования в области экономики, организации и управления промышленными предприятиями, на основе проведенных фундаментальных и прикладных разработок; формировать, оформлять, анализировать, докладывать и представлять результаты выполненной научно-исследовательской работы (ПК-3);

- способностью применять современные методы экономического анализа, наблюдения и измерения социально-экономических явлений и процессов, обработки информации и моделирования, оценки качества данных наблюдений и интерпретации результатов (ПК-4).

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

знать:

- теоретические основы риск-менеджмента и экономической безопасности предприятия;

уметь:

- самостоятельно спланировать и организовать проведение научного исследования в области риск-менеджмента и экономической безопасности деятельности предприятия на основе проведенных фундаментальных и прикладных разработок;

- формировать, оформлять, анализировать, докладывать и представлять результаты выполненной научно-исследовательской работы;

владеть:

- приемами анализа методов повышения экономической безопасности на предприятиях в процессе управления различными рисками;

- способностью разрабатывать оптимальные решения в области планирования, организации и управления деятельностью промышленных предприятий, отраслей, комплексов, эффективностью использования материальных, информационных, финансовых, человеческих и производственных ресурсов с целью их рационализации.

4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Таблица 1

| Вид учебной работы | Всего часов/зач.ед. | Семестр |
|--|------------------------------|--------------|
| | ЗФО | 4 |
| Контактная работа (всего) | 20/0,6 | 20/0,6 |
| В том числе: | | |
| Лекции | 10/0,3 | 10/0,3 |
| Практические занятия | 10/0,3 | 10/0,3 |
| Самостоятельная работа (всего) | 88/2,4 | 88/2,4 |
| В том числе: | | |
| Доклады (презентации) | 34/0,9 | 34/0,9 |
| <i>И (или) другие виды самостоятельной работы:</i> | | |
| Подготовка к практическим занятиям | 18/0,5 | 18/0,5 |
| Подготовка к зачету | 36/1 | 36/1 |
| Вид отчетности | зачет | зачет |
| Общая трудоемкость дисциплины | ВСЕГО в часах | 108 |
| | ВСЕГО в зач. единицах | 3 |

5. Содержание дисциплины

5.1. Разделы дисциплины и виды занятий

Таблица 2

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Часы лекционных занятий | Часы практич. занятий | Всего часов |
|---------------|--|-------------------------|-----------------------|-------------|
| 1. | Виды рисков и методы их оценки | 1 | 1 | 2 |
| 2. | Управление рисками | 1 | 1 | 2 |
| 3. | Способы и методы управления рисками | 2 | 2 | 4 |
| 4. | Руководство по разработке, контролю и пересмотру программы управления риском | 1 | 1 | 2 |
| 5. | Методология современного риск-менеджмента | 1 | 1 | 2 |
| 6. | Экономическая безопасность как фактор обеспечения стабильной деятельности предприятия | 1 | 1 | 2 |
| 7. | Государственное регулирование деятельности предприятий в обеспечении их экономической безопасности | 1 | 1 | 2 |
| 8. | Критерии, показатели и методы анализа экономической безопасности | 1 | 1 | 2 |
| 9. | Современные модели по обеспечению экономической безопасности предприятия | 1 | 1 | 2 |
| ИТОГО: | | 10 | 10 | 20 |

5.2. Лекционные занятия

Таблица 3

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Содержание раздела |
|-------|---------------------------------|---|
| 1. | Виды рисков и методы их оценки | Классификация и система показателей рискообразующих факторов, риск-индикаторов предприятий. Качественная оценка рисков. Экспертные методы. Количественная оценка рисков. Оценка вероятности. Метод построения дерева событий. Статистические меры риска. Предельные и средние характеристики риска. Выявление и оценка рисков в инвестиционном проекте. Налоговые риски. Операционные риски. Основные мероприятия по минимизации рисков в деятельности предприятий. Риски безопасности персонала предприятий. |
| 2. | Управление рисками | Понятие управления рисками. Цели и задачи системы управления рисками. Управление риском как часть общего менеджмента фирмы. Система управления рисками. Свойства системы управления рисками. Ограничения системы управления риском. |

| | | |
|----|--|--|
| 3. | Способы и методы управления рисками | Методы трансформации рисков и их особенности. Метод отказа от риска. Метод снижения частоты ущерба или предотвращения убытка. Метод уменьшения размера убытков. Метод разделения риска. Метод аутсорсинга риска. Метод покрытия убытка из текущего дохода. Метод покрытия убытков из резервов. Метод покрытия убытка на основе страхования и самострахования. Метод покрытия убытка на основе нестрахового пула. Метод покрытия убытка за счет передачи ответственности. Метод покрытия убытка на основе поддержки государственных органов. Метод покрытия убытков на основе спонсорства |
| 4. | Руководство по разработке, контролю и пересмотру программы управления риском | Разделы руководства: общая стратегия фирмы, цели и задачи управления рисками; процедура управления рисками, принципы управления рисками, риски, убытки фирмы, методы управления рисками. Разработка программы управления рисками, принципы разработки. Контроль и пересмотр программы управления риска, методы оценки эффективности ПУР |
| 5. | Методология современного риск-менеджмента | Методология моделирования систем управления операционной деятельностью социально-экономических систем, функционирующих в условиях неопределенности и риска. Методика оценки и минимизации рисков с учетом стадии инновационной деятельности. Разработка ССП (сбалансированной системы показателей) для предприятий малого и среднего бизнеса с учетом методов управления рисками. Комплексный подход к управлению информационными рисками на основе метода VIKOR Технология анализа хозяйственных рисков, использующая метод анализа иерархий |
| 6. | Экономическая безопасность как фактор обеспечения стабильной деятельности предприятия. | Роль и значение экономической безопасности в современных условиях как один из факторов обеспечения стабильной деятельности фирмы Концепция экономической безопасности региона и предприятия. Основные приемы и методы выявления и пресечения фактов осуществления конкурентной разведки. Содержание системы обеспечения экономической безопасности региона и фирмы. Понятие и формы криминализации экономики. Особенности криминализации экономики в России. Взаимодействие теневого сектора экономики России и других стран. |
| 7. | Государственное регулирование деятельности предприятий в обеспечении их экономической безопасности | Положительное влияние государственного регулирования деятельности предприятий на их экономическую безопасность. Влияние отрицательных последствий государственного регулирования на экономическую безопасность предприятий. Нормативно-правовое обеспечение экономической безопасности |

| | | |
|----|--|---|
| 8. | Критерии, показатели и методы анализа экономической безопасности | Алгоритм анализа уровня экономической безопасности предприятия. Частный функциональный критерий экономической безопасности предприятия. Совокупный критерий экономической безопасности предприятия. Анализ уровня экономической безопасности предприятия |
| 9. | Современные модели по обеспечению экономической безопасности предприятия | Функциональная управленческая модель обеспечения ЭБП. Модель механизма управления финансовой безопасностью предприятия. Модель обеспечения стратегической экономической безопасности в системе жизненного цикла предприятия. Алгоритм обеспечения экономической безопасности предприятия на основе снижения рисков. |

5.3. Лабораторные занятия - не предусмотрены

5.4. Практические занятия (семинары)

Таблица 4

| № п/п | Наименование раздела дисциплины | Содержание раздела |
|-------|--|---|
| 1. | Виды рисков и методы их оценки | Оценка риска конкретной ситуации различными методами и формирование заключения |
| 2. | Управление рисками | Система управления рисками |
| 3. | Способы и методы управления рисками | Сравнительный анализ методов управления рисками |
| 4. | Руководство по разработке, контролю и пересмотру программы управления риском | Разработка программы управления рисками для конкретной организации |
| 5. | Методология современного риск-менеджмента | Сравнительный анализ методологии современного риск-менеджмента |
| 6. | Экономическая безопасность как фактор обеспечения стабильной деятельности предприятия. | Составление логической схемы, описывающей экономические угрозы и способы противодействия им |
| 7. | Государственное регулирование деятельности предприятий в обеспечении их экономической безопасности | Нормативно-правовое обеспечение экономической безопасности |
| 8. | Критерии, показатели и методы анализа экономической безопасности | Анализ уровня экономической безопасности предприятия |
| 9. | Современные модели по обеспечению экономической безопасности предприятия | Сравнительный анализ моделей по обеспечению экономической безопасности предприятия |

6. Самостоятельная работа аспирантов по дисциплине

Самостоятельная работа аспирантов в ходе семестра является важной составной частью учебного процесса и необходима для закрепления и углубления знаний, полученных в период сессии на лекциях, развитие практических умений. а также для индивидуального изучения дисциплины в соответствии с программой и рекомендованной литературой.

Основные направления самостоятельной работы аспирантов:

- 1) работа с лекционным материалом, поиск и обзор литературы и электронных источников информации по индивидуально заданной проблеме курса;
- 2) опережающая самостоятельная работа, которая предполагает предварительное ознакомление с материалом лекции в процессе подготовки опорного конспекта;
- 3) подготовка доклада с презентацией.

6.1 Темы докладов с презентацией

1. Управление рисками в деятельности фирмы.
2. Финансовые риски.
3. Инвестиционные риски.
4. Имущественные риски.
5. Риск, связанный с потерей имущества в результате стихийных бедствий
6. Риск, связанный с потерей имущества вследствие действий злоумышленников.
7. Риск, связанный с отчуждением имущества в результате действий органов власти и других собственников.
8. Риск утраты или повреждения имущества из-за аварийной ситуации на производстве.
9. Риск утраты или порчи имущества во время транспортировки.
10. Производственные риски и промышленная безопасность производства.
11. Риски усиления конкуренции.
12. Риски возникновения непредвиденных расходов и снижения доходов.
13. Спекулятивные риски
14. Анализ рыночного риска: активы, входящие в портфель.
15. Обеспечение стабильной деятельности фирм.
16. Нормативно-правовое обеспечение экономической безопасности фирмы.
17. Критерии и методы анализа экономической безопасности фирмы.
18. Методы обеспечения экономической безопасности фирмы.
19. Система экономической безопасности фирмы.
20. Система экономической безопасности региона.

6.2 Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы

1. Алексеенко В.Б. Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие/ Алексеенко В.Б., Кутлыева Г.М., Мочалова Ю.И. – Электрон. текстовые данные. – М.: Российский университет дружбы народов, 2013. – 88 с. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/22224>. – ЭБС «IPRbooks»

2. Балдин К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С. – Электрон. текстовые данные. – М.: Дашков и К, 2015. – 418 с. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/14110>. – ЭБС «IPRbooks»

7. Оценочные средства

7.1 Вопросы к зачету

1. Методы качественной оценки рисков.
2. Методы количественной оценки рисков.
3. Методы трансформации рисков и их особенности.
4. Метод отказа от риска. Метод снижения частоты ущерба или предотвращения убытка.
5. Метод уменьшения размера убытков. Метод разделения риска. Метод аутсорсинга риска
6. Метод покрытия убытка из текущего дохода. Метод покрытия убытков из резервов. Метод покрытия убытка на основе страхования и самострахования.
7. Метод покрытия убытка на основе нестрахового пула. Метод покрытия убытка за счет передачи ответственности.
8. Метод покрытия убытка на основе поддержки государственных органов. Метод покрытия убытков на основе спонсорства
9. Разделы руководства по разработке, контролю и пересмотру программы управления риском.
10. Разработка программы управления рисками, принципы разработки. Контроль и пересмотр программы управления риском, методы оценки эффективности ПУР.
11. Методология моделирования систем управления операционной деятельностью социально-экономических систем, функционирующих в условиях неопределенности и риска.
12. Методика оценки и минимизации рисков с учетом стадии инновационной деятельности.
13. Разработка ССП (сбалансированной системы показателей) для предприятий малого и среднего бизнеса с учетом методов управления рисками.
14. Комплексный подход к управлению информационными рисками на основе метода VIKOR Технология анализа хозяйственных рисков, использующая метод анализа иерархий
15. Концепция экономической безопасности региона и предприятия.
16. Основные приемы и методы выявления и пресечения фактов осуществления конкурентной разведки.
17. Содержание системы обеспечения экономической безопасности региона и фирмы.
18. Нормативно-правовое обеспечение экономической безопасности.
19. Алгоритм анализа уровня экономической безопасности предприятия. Частный функциональный критерий экономической безопасности предприятия.
20. Совокупный критерий экономической безопасности предприятия. Анализ уровня экономической безопасности предприятия.
21. Функциональная управленческая модель обеспечения экономической безопасности предприятия.
22. Модель механизма управления финансовой безопасностью предприятия.
23. Модель обеспечения стратегической экономической безопасности в системе жизненного цикла предприятия.
24. Алгоритм обеспечения экономической безопасности предприятия на основе снижения рисков

Образец билета к зачету

ГРОЗНЕНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ НЕФТЯНОЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ имени академика М.Д. Миллионщикова

Дисциплина Риск-менеджмент и экономическая безопасность предприятия

Институт ЦЭиТП группа _____ семестр _____

БИЛЕТ №1

1. Методы качественной оценки рисков.
2. Концепция экономической безопасности региона и предприятия.

УТВЕРЖДАЮ:

« _____ » _____ 20 ____ г.

Зав. кафедрой _____

7.2 Текущий контроль

Текущий контроль успеваемости аспирантов складывается из оценки подготовленных ими докладов (презентаций), а также их активности на лекциях.

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

а) основная литература

1. Донцов Г.Ю. Экономическая безопасность: Учебное пособие. – Томск: ТУСУР, 2012. – 112 с.
2. Коршикова М.В. Диверсификация в управлении хозяйственными рисками: метод анализа иерархий. // Вестник АПК Ставрополя. 2015, № 2 (18). – с. 259-263.
3. Лебедева Н.А. Экономическая безопасность предприятия. – М.: МАБИВ, 2012. – 162 с.
4. Одинцова М.А. Разработка ССП для предприятий малого и среднего бизнеса с учетом методов управления рисками. // Экономический журнал. 2014, № 2 (34). – с. 6-15.
5. Суглобов А.Е. Экономическая безопасность предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2013. – 271с. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/21011>. – ЭБС «IPRbooks».
6. Студенников К.О., Лопин В.Н. Комплексный подход к управлению информационными рисками на основе метода VIKOR. // Вопросы защиты информации. 2015, № 2 (109). – с. 69-73.
7. Фирсова О.А. Экономическая безопасность предприятия [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие. – Орел: Межрегиональная Академия безопасности и выживания (МАБИВ), 2014. – 165 с. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/33466>. – ЭБС «IPRbooks»

б) дополнительная литература

1. Антикризисное управление. Теория и практика [Электронный ресурс]: учебное пособие. / В.Я. Захаров [и др.]. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012. – 304 с. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/7034>. – ЭБС «IPRbooks».

2. Балдин К.В. Управление рисками [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В. – Электрон. текстовые данные.– М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012. – 512 с. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/10513>. – ЭБС «IPRbooks»

3. Балдин К.В. Управление рисками в инновационно-инвестиционной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С. – Электрон. текстовые данные. – М.: Дашков и К, 2015. – 418 с. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/14110>. – ЭБС «IPRbooks»

4. Алексеенко В.Б. Управление рисками в производственно-хозяйственной деятельности предприятия [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие/ Алексеенко В.Б., Кутлыева Г.М., Мочалова Ю.И. – Электрон. текстовые данные. – М.: Российский университет дружбы народов, 2013. – 88 с. – Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/22224>. – ЭБС «IPRbooks»

5. О Государственной стратегии экономической безопасности Российской Федерации: Указ Президента РФ от 29.04.1996 №608 [Электронный ресурс]. Режим доступа: URL: <http://base.garant.ru/106503/>.<http://www.gov.ru>

в) Интернет-ресурсы

<http://www.gov.ru>

<http://www.constitution.ru>

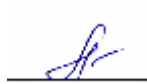
<http://www.knigafond.ru>

9. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебная аудитория, оснащенная аппаратурой для видеопрезентаций лекций, компьютерный класс с подключением к сети INTERNET.

Составитель:

к.э.н., доцент



/Л.А.Геиева/

Согласовано:

Зав. каф. «ЭУП»



/Якубов Т.В./

Начальник ОПКВК



/Ахмадова З.Р./

Директор ДУМР



/Магомаева М.А./