

Минобрнауки России

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Оренбургский государственный университет»

Кафедра статистики и эконометрики

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

ДИСЦИПЛИНЫ

*«Б.1.В.ДВ.6.1 Статистическое обеспечение инвестиционных программ производства продукции
(услуг) и управление запасами в условиях риска»*

Уровень высшего образования

БАКАЛАВРИАТ

Направление подготовки

38.03.01 Экономика

(код и наименование направления подготовки)

Бизнес-аналитика и статистика

(наименование направленности (профиля) образовательной программы)

Тип образовательной программы

Программа академического бакалавриата

Квалификация

Бакалавр

Форма обучения

Очная

Рабочая программа рассмотрена и утверждена на заседании кафедры

Кафедра статистики и эконометрики

исполнительная кафедра

протокол № 17 от 15.02.2016 г.

Заведующий кафедрой

Кафедра статистики и эконометрики

подпись

В.Н. Афанасьев

расшифровка подписи

Исполнители:

ст. преподаватель

подпись

подпись

С.Н. Морозова

расшифровка подписи

подпись

подпись

расшифровка подписи

СОГЛАСОВАНО:

Председатель методической комиссии по направлению подготовки

38.03.01 Экономика

подпись

подпись

А.М. Балкина

расшифровка подписи

Заведующий отделом комплектования научной библиотеки

подпись

Н.Н. Грицай

расшифровка подписи

Уполномоченный по качеству факультета

подпись

А.А. Момкина

расшифровка подписи

№ регистрации 31192

1 Цели и задачи освоения дисциплины

Цель освоения дисциплины - овладение студентами теоретическими знаниями и практическими навыками в области статистического обеспечения инвестиционных программ производства продукции (услуг) и управление запасами в условиях риска.

Задачи:

- обучить студентов основным понятиям, используемым при разработки инвестиционных программ;
- обучить использованию эконометрических методов для оценки риска реализации инвестиционного проекта;
- показать возможность применения методов многомерной статистики для оценки риска реализации инвестиционного проекта с позиции инвестора;
- дать представление об основах риск-менеджмента;
- рассмотреть основные методы снижения риска реализации инвестиционного проекта с позиции инвестора.

2 Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина относится к дисциплинам (модулям) по выбору вариативной части блока 1 «Дисциплины (модули)»

Пререквизиты дисциплины: *Б.1.Б.14 Эконометрика, Б.1.Б.21 Региональная экономика, Б.1.В.ОД.12 Многомерный статистический анализ и линейное программирование в бизнес-проектах*

Постреквизиты дисциплины: *Отсутствуют*

3 Требования к результатам обучения по дисциплине

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих результатов обучения

Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций	Формируемые компетенции
<u>Знать:</u> месторасположение источников статистической информации о риске реализации инвестиционных программ. <u>Уметь:</u> собирать, обобщать и анализировать информацию о риске реализации инвестиционных программ. <u>Владеть:</u> Навыками сбора информации о риске реализации инвестиционных программ и расчета показателей необходимых для принятия решения о запуске инвестиционного проекта.	ПК-1 способностью собирать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов
<u>Знать:</u> содержание и методику анализа бухгалтерской (финансовой) отчетности предприятия; систему сбора и обобщения информации отчетности предприятия; содержание отчетности, соответствующей международным стандартам. <u>Уметь:</u> выбирать современные и рациональные способы проведения анализа бухгалтерской (финансовой) отчетности предприятия; применять современные приемы и способы аналитических расчетов; проводить факторный анализ по основным показателям бухгалтерской (финансовой) отчетности предприятия; выявлять неиспользованные резервы экономии затрат, наращивания доходов и формирования положительных финансовых результатов; применять профессиональное суждение при использовании нормативных актов, регулирующих методические и методологические аспекты анализа	ПК-5 способностью анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д., и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений

Планируемые результаты обучения по дисциплине, характеризующие этапы формирования компетенций	Формируемые компетенции
бухгалтерской (финансовой) отчетности предприятия Владеть: механизмом реализации методических аспектов анализа бухгалтерской (финансовой) отчетности предприятия; способностью сбора и обобщения данных внешних и внутренних информационных источников, необходимых для выработки управленческих решений	

4 Структура и содержание дисциплины

4.1 Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачетных единиц (180 академических часов).

Вид работы	Трудоемкость, академических часов	
	8 семестр	всего
Общая трудоёмкость	180	180
Контактная работа:	38,5	38,5
Лекции (Л)	18	18
Практические занятия (ПЗ)	18	18
Консультации	1	1
Индивидуальная работа и инновационные формы учебных занятий	1	1
Промежуточная аттестация (зачет, экзамен)	0,5	0,5
Самостоятельная работа: - выполнение курсовой работы (КР); - самоподготовка (проработка и повторение лекционного материала и материала учебников и учебных пособий); - подготовка к практическим занятиям).	141,5 +	141,5
Вид итогового контроля (зачет, экзамен, дифференцированный зачет)	экзамен	

Разделы дисциплины, изучаемые в 8 семестре

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов				
		всего	аудиторная работа			внеауд. работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1.	Статистическое обеспечение инвестиционных программ производства продукции (услуг) и управление запасами в условиях риска	24	2	2	-	20
2.	Управление движением товаров и запасами	24	2	2	-	20
3.	Инвестиции и инвестиционные проекты	24	2	2	-	20
4.	Роль бизнес-плана в снижении риска реализации инвестиционных проектов	24	2	2	-	20
5.	Эконометрическое моделирование риска реализации инвестиционных проектов	24	2	2	-	20
6.	Многомерные статистические методы в оценке риска реализации инвестиционных проектов	30	4	4	-	22
7.	Основы риск-менеджмента	30	4	4	-	22
	Итого:	180	18	18	-	144
	Всего:	180	18	18	-	144

4.2 Содержание разделов дисциплины

1. Статистическое обеспечение инвестиционных программ производства продукции (услуг) и управление запасами в условиях риска. Цель и задачи дисциплины. Основные понятия, используемые при оценке рисков инвестиционной деятельности.

2. Управление движением товаров и запасами. Воспроизводственный процесс. Стадии производства продукции (услуг). Запасы на предприятии их функции. Учет запасов. Движение запаса в звеньях цепей поставок. Техника прогнозирования потребности в запасе. Управление различными группами позиций запасов. Расчет оптимального размера заказа на восполнение запаса

3. Инвестиции и инвестиционные проекты. Сущность понятий «инвестиции» и «инвестиционные проекты». Классификация инвестиционных проектов. Методы оценки успешности инвестиционных проектов. Введение в инвестиционный анализ.

4. Роль бизнес-плана в снижении риска реализации инвестиционных проектов. Понятие бизнес-плана и решаемые с его помощью задачи. Пользователи бизнес-плана. Структура бизнес-плана. Последовательность разработки бизнес-плана. Показатели, характеризующие эффективность инвестиционного проекта.

5. Эконометрическое моделирование риска реализации инвестиционных проектов. Классификация эконометрических моделей риска. Подготовка исходной информации для построения модели влияния факторов на уровень риска. Logit-модели в моделировании риска.

6. Многомерные статистические методы в оценке риска реализации инвестиционных проектов. Оценка риска реализации проекта с позиции инвестора. Скоринговые модели в банковском деле. Группировка проектов по вероятности реализации на основе кластерного анализа. Построение дискриминантной функции для оценки вероятности реализации инвестиционного проекта.

7. Основы риск-менеджмента. Понятие «риска». Классификация рисков. Количественные и качественные методы изучения оценки риска. Методы борьбы с рисками предпринимательской деятельности.

4.3 Практические занятия

№ занятия	№ раздела	Тема	Кол-во часов
1	1	Статистическое обеспечение инвестиционных программ производства продукции (услуг) и управление запасами в условиях риска	2
2	2	Управление движением товаров и запасами	2
3	3	Инвестиции и инвестиционные проекты	2
4	4	Роль бизнес-плана в снижении риска реализации инвестиционных проектов	2
5	5	Эконометрическое моделирование риска реализации инвестиционных проектов	2
6-7	6	Многомерные статистические методы в оценке риска реализации инвестиционных проектов	4
8-9	7	Основы риск-менеджмента	4
		Итого:	18

4.4 Курсовая работа (8 семестр)

1. Информационная база статистики инвестиционной деятельности в РФ.
2. Статистическая методология оценки и анализа эффективности инвестиционных проектов.
3. Статистические методы определения потребности фирмы в запасах.
4. Статистические методы анализа инвестиционных решений.
5. Отечественный опыт статистической оценки инвестиционных проектов.
6. Зарубежный опыт статистической оценки инвестиционных проектов.
7. Факторы, обуславливающие различные виды рисков в условиях неопределенности.
8. Статистические модели и коэффициенты, используемые при оценке риска инвестиционных проектов.
9. Методы статистического анализа капитальных вложений и их конечных результатов.
10. Статистический анализ инвестиционных проектов.
11. Статистический анализ динамики запасов в условиях риска.
12. Структурный статистический анализ запасов фирмы.
13. Принципиальные положения расчета показателей эффективности инвестиций с учетом фактора времени.
14. Статистическая методология в анализе окупаемости инвестиций.
15. Статистическая оценка инвестиций, осуществляемых в форме капитальных вложений.
16. Статистическая оценка инвестиций в нефинансовые активы.
17. Статистическая оценка финансовой состоятельности инвестиционного проекта.
18. Методы интерполяции и экстраполяции в анализе денежных потоков инвестиционного проекта.
19. Статистические методы сравнительной оценки инвестиционных проектов.
20. Статистические методы оценки рисков при принятии инвестиционных решений.
21. Сущность статистического анализа в задаче риск-менеджмента.
22. Модели оценки и прогнозирования инвестиционных рисков.
23. Прогнозы последствий экономических решений в области инвестиционной политики.
24. Эконометрические модели влияния факторов на уровень инвестиционных рисков.
25. Методы многомерной классификации в оценке рисков реализации инвестиционных проектов.
26. Этапы разработки и структура бизнес-плана фирмы.
27. Методы идентификации рисков (статистические, аналитические и экспертные) и особенности их информационного обеспечения.
28. Принципы построения прогнозных моделей управления рисками.
29. Стратегии управления рисками и затраты на их реализацию. Критерии оптимизации деятельности в условиях рисков.
30. Методы оценки эффективности рискоснижающих затрат: «затраты-выгода», «затраты-риски», «риски-выгода».
31. Статистические методы оценки ожидаемой доходности и волатильности портфеля рискованных активов.
32. Статистическая оценка эффективности управления инвестиционным фондом.
33. Статистические методы расчёта потребности в дополнительном финансировании инвестиционных проектов.
34. Учет неопределенности риска в инвестиционных проектах.
35. Статистическая оценка устойчивости инвестиционного проекта.
36. Статистические методы количественной оценки предпринимательских рисков.
37. Методы статистического прогнозирования величины оборотных средств фирмы.
38. Рациональное управление запасами как фактор роста прибыли.
39. Основные категории запасов и факторы, обуславливающие их величину.
40. Информационная база статистики оборотных средств и запасов фирмы.
41. Статистические методы контроля за движением материальных ресурсов.
42. Программные продукты для оценки эффективности инвестиционных проектов.
43. Методы количественной оценки риска вложений.
44. Статистические методы учета и контроля запасов продукции на складе.

45. Статистическая оценка влияния инфляции и рисков на эффективность инвестиций проектов.
46. Бизнес-план инвестиционного проекта.
47. Статистические методы минимизации рисков инвестиционных проектов.
48. Методы статистического анализа использования материальных ресурсов и состояния их запасов.
49. Статистические методы контроля формирования запасов фирмы.
50. Статистическая оценка экономической эффективности страхования инвестиционных рисков.
51. Статистические методы прогнозирования денежных потоков фирмы.
52. Информационно-статистическое обеспечение инвестиционных проектов.
53. Использование методов статистического анализа в управлении запасами.
54. Прикладной статистический анализ при разработке инвестиционных проектов.
55. Методологические аспекты разработки системы статистического обеспечения управления инвестиционными проектами.
56. Статистический анализ инвестиционной активности организаций различных видов экономической деятельности.

5 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Основная литература

1. Подкопаева, М. О. Экономическая оценка инвестиций: учеб. пособие / М. О. Подкопаева, О. В. Федорищева; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. гос. бюджет. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург. гос. ун-т". - Оренбург : Университет, 2012. - 220 с. - ISBN 978-5-4417-0055-9.
2. Эконометрика для бакалавров: учебник / В. Н. Афанасьев [и др.]; под ред. В. Н. Афанасьева; М-во образования и науки Рос. Федерации, Федер. гос. бюджет. образоват. учреждение высш. проф. образования "Оренбург. гос. ун-т". - 2-е изд., перераб. и доп. - Оренбург : Университет, 2014. - 422 с. - ISBN 978-5-4417-0345-1.

5.2 Дополнительная литература

1. Акуленко Н. Б. Экономический анализ: учеб. пособие / Н.Б. Акуленко, В.Ю. Гарнова, В.А. Колоколов; Под ред. Н.Б. Акуленко и В.Ю. Гарновой - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 157 с. - ISBN 978-5-16-006202-0. – Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=367648>
2. Анализ финансовой отчетности: учеб. пособие / О. В. Ефимова [и др.]. - Москва : Омега - Л, 2013. - 389 с. - ISBN 978-5-370-02671-3.
3. Комплексный экономический анализ хозяйственной деятельности: учеб. пособие / А. И. Алексеева и др. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва : КНОРУС, 2013. - 720 с. - ISBN 978-5-406-03152-0
- Иванов И. Н. Экономический анализ деятельности предприятия: учебник / И.Н. Иванов. - М.: НИЦ Инфра-М, 2013. - 348 с. - ISBN 978-5-16-005608-1. – Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=346196>
4. Цыпин, А. П. Статистика в табличном редакторе Microsoft Excel: лабораторный практикум / А. П. Цыпин, Л. Р. Фаизова. – Оренбург: ОГУ, 2016. – 291 с. – ISBN 978-5-600-01-401-5.
5. Экономический анализ: Основы теории. Комплексный анализ хозяйственной деятельности организации: учебник для бакалавров: учебник / под ред. Н. В. Войтоловского, А. П. Калининой, И. И. Мазуровой; С.-Петерб. гос. экон. ун-т.- 4-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юрайт, 2014. - 549 с. - ISBN 978-5-9916-3316-1.

5.3 Периодические издания

1. Вопросы статистики: журнал. - М.: Агентство "Роспечать", 2016.
2. Проблемы прогнозирования: журнал. - М.: Агентство "Роспечать", 2016.

3. Прикладная эконометрика/ Applied econometrics: журнал. - М.: Агентство "Роспечать", 2016.
4. Управление риском: журнал. - М.: Агентство "Роспечать", 2016.
5. Финансы и бизнес: журнал. - М.: ИД "Финансы и кредит", 2016.

5.4 Интернет-ресурсы

1. <http://www.gks.ru>. – Федеральная служба государственной статистики
2. <http://www.hse.ru>. – Национальный исследовательский университет «Высшая школа экономики»
3. <http://www.cbr.ru>. - Центральный Банк России

5.5 Программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Операционная система Microsoft Windows.
2. Пакет настольных приложений Microsoft Office (Word, Excel, PowerPoint, OneNote, Outlook, Publisher, Access).
3. STATISTICA for Windows v.6.Ru.
4. Консультант Плюс [Электронный ресурс]: справочно-правовая система / Компания Консультант Плюс. – Электрон. дан. – Москва, [1992– 2016]. – Режим доступа: в локальной сети ОГУ \\fileserver1\CONSULT\cons.exe
5. Гарант [Электронный ресурс]: справочно-правовая система / НПП Гарант-Сервис. – Электрон. дан. – Москва, [1990–2016].– Режим доступа <\\fileserver1\GarantClient\garant.exe> в локальной сети ОГУ.

6 Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, практических занятий, курсового проектирования, для проведения групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

Аудитории оснащены комплектами ученической мебели, техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Помещение для самостоятельной работы обучающихся оснащены компьютерной техникой, подключенной к сети "Интернет", и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду ОГУ.