

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с индикаторами достижения компетенций

Компетенция	Содержание компетенции	Индикатор	Содержание индикатора
ПК-13	Способен анализировать риски, вероятность и объем экономических потерь; обобщать отечественную и зарубежную практику таможенно-тарифной политики и опыт проведения международных валютных, финансовых и кредитных операций	ПК-13.1	Демонстрирует знания методов анализа и оценки рисков
		ПК-13.2	Способен осуществлять оценку вероятности наступления рисков ситуаций
ПК-15	Способен осуществлять разработку проектных решений, разделов бизнес-планов организации	ПК-15.2	Способен выполнять экономические расчеты бизнес-проектов

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплины (практики), предшествующие изучению дисциплины, результаты освоения которых необходимы для освоения данной дисциплины.	Бизнес-проектирование, Математика для экономических расчетов, Экономика организаций, Экономический анализ
Дисциплины (практики), для которых результаты освоения данной дисциплины будут необходимы, как входные знания, умения и владения для их изучения.	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы, Преддипломная практика

3. Объем дисциплины в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающегося с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающегося

Общий объем дисциплины в з.е. /час: 3 / 108

Форма промежуточной аттестации: Зачет

Форма обучения	Виды занятий, их трудоемкость (час.)				Объем контактной работы обучающегося с преподавателем (час)
	Лекции	Лабораторные работы	Практические занятия	Самостоятельная работа	
очно - заочная	24	0	24	60	57

4. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий

Форма обучения: очно - заочная

Семестр: 10

Лекционные занятия (24ч.)

1. Риски как экономическая категория(2ч.)[2,3,5,13] Сущность и виды рисков предприятия. Риск как экономическая категория и его сущность.

Понятие неопределенности и риска. Основные виды неопределенностей в экономической

деятельности. Классификация рисков. Основные черты риска. Факторы риска. Природа

риска. Анализ рисков, вероятности и объема экономических потерь.

2. Анализ и оценки риска в системе управления предприятием(4ч.)[2,3,6,9,11]

Управление рисками предприятия. Характеристика основных элементов системы управления

рисками предприятия. Алгоритм управления рисками предприятия. Методы управления

рисками: принципы управления, алгоритм управления. Процесс управления операционными

рисками. Оценка рисков при разработке проектных решений, разделов бизнес-планов организации.

3. Измерители и показатели производственных рисков(2ч.)[2,3,4,5,6,7,9,11]

Математические модели и методы оценки риска: методы анализа операционных рисков

предприятия; измерители и система показатели оценки риска. Система показателей оценки

риска. Показатели оценки риска в условиях неопределенности. Показатели оценки операционного риска в условиях частичной и полной неопределенности и их применение.

Условия частичной неопределенности. Условия полной неопределенности: точечная оценка

риска, предельные значения показателей риска.

4. Методы анализа и оценки рисков предприятия(4ч.)[2,3,4,6,9,11] Методы

анализа рисков. Формализация частичной неопределенности и применение теории вероятности в задачах оценки риска. Закон нормального распределения;

интервальная

оценка риска. Статистические показатели риска: среднее значение, выборочная средняя,

математическое ожидание, стандартное отклонение, дисперсия, доверительный

интервал,

коэффициент вариации. Предельные значения показателей риска.

5. Методы оценки рисков в условиях неопределенности(4ч.)[2,3,4,6] Теория матричных игр в оценке риска: матрица последствий и матрица рисков. Критерии количественной оценки риска в условиях неопределенности: критерий Сэвиджа; критерий

Гурвица; критерий Вальда; критерий Байеса. Байеса. Выбор решений в условиях частичной

неопределенности: критерий рациональности Лапласа.

6. Основы формирования оптимального портфеля ценных бумаг(4ч.)[2,3,9,11,12,13,14] Оценка риска на основе принципа оптимальности Парето: постановка задачи; множество

оптимальности по Парето, эффективность операций на основе показателей математического

ожидания доходности и среднеквадратической мерой риска. Инвестиционный эффективный

портфель.

7. Экспертные методы оценки риска(4ч.)[2,3,4] Экспертные методы оценки риска Метод статистической обработки результатов экспертизы.

Оценка согласованности мнений экспертов

Практические занятия (24ч.)

1. Риски как экономическая категория {беседа} (2ч.)[2,3,4,12,13] Сущность и виды рисков предприятия. Риск как экономическая категория и его сущность.

Понятие неопределенности и риска. Основные виды неопределенностей в экономической

деятельности. Классификация рисков. Основные черты риска. Факторы риска.

Природа

риска. Анализ рисков, вероятности и объема экономических потерь.

2. Анализ и оценки риска в системе управления предприятием(2ч.)[2,3,4,11,12,13] Управление рисками предприятия.

Характеристика основных элементов системы управления

рисками предприятия. Алгоритм управления рисками предприятия. Методы управления

рисками: принципы управления, алгоритм управления. Процесс управления операционными

рисками. Оценка рисков при разработке проектных решений, разделов бизнес-планов организации.

3. Измерители и показатели производственных рисков(4ч.)[2,3,4,11]

Математические модели и методы оценки риска: методы анализа операционных рисков

предприятия; измерители и система показатели оценки риска. Система показателей оценки

риска. Показатели оценки риска в условиях неопределенности. Показатели оценки операционного риска в условиях частичной и полной неопределенности и их применение.

Условия частичной неопределенности. Условия полной неопределенности: точечная оценка

риска, предельные значения показателей риска.

4. Методы анализа и оценки рисков предприятия(4ч.)[2,3,4,10,12] Методы анализа рисков. Формализация частичной неопределенности и применение теории вероятности в задачах оценки риска. Закон нормального распределения; интервальная

оценка риска. Статистические показатели риска: среднее значение, выборочная средняя,

математическое ожидание, стандартное отклонение, дисперсия, доверительный интервал,

коэффициент вариации. Предельные значения показателей риска.

5. Методы оценки рисков в условиях неопределенности(4ч.)[2,3,4,12] Теория матричных игр в оценке риска: матрица последствий и матрица рисков. Критерии количественной оценки риска в условиях неопределенности: критерий Сэвиджа; критерий

Гурвица; критерий Вальда; критерий Байеса. Выбор решений в условиях частичной

неопределенности: критерий рациональности Лапласа.

6. Основы формирования оптимального портфеля ценных бумаг(4ч.)[2,3,4,11,12,13,14] Оценка риска на основе принципа оптимальности Парето: постановка задачи; множество

оптимальности по Парето, эффективность операций на основе показателей математического

ожидания доходности и среднеквадратической мерой риска. Инвестиционный эффективный

портфель.

7. Экспертные методы оценки риска(4ч.)[2,3,4,11,12,13] Экспертные методы оценки риска Метод статистической обработки результатов экспертизы.

Оценка согласованности мнений экспертов

Самостоятельная работа (60ч.)

1. Подготовка к практическим занятиям(17ч.)[2,3,4,5,6,7,8,9,10,11,12,13,14]

2. Проработка теоретического материала по темам курса(12ч.)[2,3,4,5,6,7,8,9,10,11,12,13,14] Проработка конспектов лекций. Самостоятельное изучение нормативных актов и учебной литературы

3. Подготовка к текущей аттестации(4ч.)[2,3,4,5,6,7,8,9,10,11,12,13,14]

4. Подготовка учебно-исследовательской работы(18ч.)[2,3,4,5,6,7,8,9,10,11,12,13,14] Подготовка учебно-исследовательской работы

5. Подготовка к промежуточной аттестации(9ч.)[2,3,4,5,6] Подготовка к промежуточной аттестации

5. Перечень учебно-методического обеспечения самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

Для каждого обучающегося обеспечен индивидуальный неограниченный доступ к электронно-библиотечным системам: Лань, Университетская библиотека он-лайн, электронной библиотеке АлтГТУ и к электронной информационно-образовательной среде:

1. Казитова, Э.И. Методические рекомендации по подготовке к практическим занятиям и выполнению самостоятельной работы студентов по дисциплине «Оценка рисков» / Э.И. Казитова; Алт. гос. тех. ун-т им. И.И. Ползунова. – Барнаул: Изд-во АлтГТУ, 2022. – 8 с. - Прямая ссылка: http://elib.altstu.ru/eum/download/meo/Kasitova_OcRisk_mu.pdf

6. Перечень учебной литературы

6.1. Основная литература

2. Терехова, Е. А. Экономическая оценка рисков : учебное пособие / Е. А. Терехова, Н. В. Мозолева. — Москва : Российская таможенная академия, 2016. — 100 с. — ISBN 978-5-9590-0886-4. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/69853.html> (дата обращения: 24.02.2022). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

3. Деревяшкин, С. А. Оценка рисков : [16+] / С. А. Деревяшкин ; Поволжский государственный технологический университет. — Йошкар-Ола : Поволжский государственный технологический университет, 2019. — 74 с. : табл., граф., схем., ил. — Режим доступа: по подписке. — URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=570617> (дата обращения: 24.02.2022). — Библиогр. в кн. — ISBN 978-5-8158-2097-5. — Текст : электронный.

4. Шорохов, С. Г. Введение в модели количественной оценки рыночных рисков : учебное пособие / С. Г. Шорохов. — Москва : Российский университет дружбы народов, 2017. — 124 с. — ISBN 978-5-209-07498-4. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/90984.html> (дата обращения: 24.02.2022). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

6.2. Дополнительная литература

5. Тихомиров, Н. П. Теория риска : учебник / Н. П. Тихомиров, Т. М. Тихомирова ; Российский экономический университет им. Г.В. Плеханова. — Москва : Юнити, 2020. — 308 с. : ил., табл., граф. — Режим доступа: по подписке. — URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=615777> (дата обращения:

24.02.2022). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-238-03413-3. – Текст : электронный.

6. Прогнозирование и оценка производственных рисков : учебник / З. Н. Монахова, М. С. Монахов, Г. О. Барбаков, Л. Н. Скипин. — Тюмень : Тюменский индустриальный университет, 2019. — 105 с. — ISBN 978-5-9961-2038-3. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/101448.html> (дата обращения: 24.02.2022). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

7. Марченко, Б. И. Анализ риска: основы оценки экологического риска : учебное пособие / Б. И. Марченко. — Ростов-на-Дону, Таганрог : Издательство Южного федерального университета, 2018. — 148 с. — ISBN 978-5-9275-3061-8. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/87699.html> (дата обращения: 24.02.2022). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

8. Матвеевко, И. А. Введение в оценку экологических рисков : учебно-методическое пособие / И. А. Матвеевко, Н. А. Осипова. — Томск : Томский политехнический университет, 2015. — 108 с. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/55187.html> (дата обращения: 24.02.2022). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

9. Оценка рисков в проектном менеджменте : учебное пособие / Е. И. Капустина, О. П. Григорьева, Ю. С. Скрипниченко [и др.]. — Ставрополь : Ставропольский государственный аграрный университет, 2017. — 152 с. — Текст : электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART : [сайт]. — URL: <https://www.iprbookshop.ru/76047.html> (дата обращения: 24.02.2022). — Режим доступа: для авторизир. пользователей

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины

10. Налоговый кодекс Российской Федерации [Электронный ресурс]. - Режим доступа: http://nalog.garant.ru/fns/nk/14/#block_20009 (Доступ из справ.-правовой системы "Гарант").

11. Русское общество управления рисками. - Режим доступа: <http://rrms.ru/about/>.

12. Сайт компании Ernst & Young. - Режим доступа: https://www.ey.com/ru_ru/risk.

13. Сайт компании PwC. URL: <https://www.pwc.ru/ru/services/riskassurance/enterprise-risk-management.html>

14. Федеральный закон "О рынке ценных бумаг" от 22.04.1996 N 39-ФЗ . - Режим доступа: http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_10148/3/ (Доступ из справ.-правовой системы "КонсультантПлюс").

8. Фонд оценочных материалов для проведения текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации

Содержание промежуточной аттестации раскрывается в комплекте контролирующих материалов, предназначенных для проверки соответствия уровня подготовки по дисциплине требованиям ФГОС, которые хранятся на кафедре-разработчике РПД в печатном виде и в ЭИОС.

Фонд оценочных материалов (ФОМ) по дисциплине представлен в приложении А.

9. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Для успешного освоения дисциплины используются ресурсы электронной информационно-образовательной среды, образовательные интернет-порталы, глобальная компьютерная сеть Интернет. В процессе изучения дисциплины происходит интерактивное взаимодействие обучающегося с преподавателем через личный кабинет студента.

№пп	Используемое программное обеспечение
1	Acrobat Reader
1	LibreOffice
2	Chrome
2	Windows
3	Антивирус Kaspersky
4	Microsoft Office
7	(БТИ) КонсультантПлюс
8	Гарант
9	Налогоплательщик ЮЛ

№пп	Используемые профессиональные базы данных и информационные справочные системы
1	База данных Росреестра – сведения о ЕГРН (единый государственный реестр недвижимости) (https://rosreestr.ru/)
1	Бесплатная электронная библиотека онлайн "Единое окно к образовательным ресурсам" для студентов и преподавателей; каталог ссылок на образовательные интернет-ресурсы (http://Window.edu.ru)
2	«Базовые нормативные документы» ООО «Группа компаний Кодекс», программные продукты «Кодекс» и «Техэксперт» (https://kodeks.ru)
2	Национальная электронная библиотека (НЭБ) — свободный доступ читателей к фондам российских библиотек. Содержит коллекции оцифрованных документов (как открытого доступа, так и ограниченных авторским правом), а также каталог изданий, хранящихся в библиотеках России. (http://нэб.рф/)
5	Электронный фонд правовой и научно-технической документации - (http://docs.cntd.ru/document)

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

Наименование специальных помещений и помещений для самостоятельной работы
учебные аудитории для проведения учебных занятий
помещения для самостоятельной работы

Материально-техническое обеспечение и организация образовательного процесса по дисциплине для инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья осуществляется в соответствии с «Положением об обучении инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья».