

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ «Оценка рисков»

по основной профессиональной образовательной программе по направлению подготовки
38.03.01 «Экономика» (уровень бакалавриата)

Направленность (профиль): Экономика и управление организацией

Общий объем дисциплины – 3 з.е. (108 часов)

Форма промежуточной аттестации – Зачет.

В результате освоения дисциплины у обучающихся должны быть сформированы компетенции с соответствующими индикаторами их достижения:

- ПК-13.1: Демонстрирует знания методов анализа и оценки рисков;
- ПК-13.2: Способен осуществлять оценку вероятности наступления рискованных ситуаций;
- ПК-15.2: Способен выполнять экономические расчеты бизнес-проектов;

Содержание дисциплины:

Дисциплина «Оценка рисков» включает в себя следующие разделы:

Форма обучения очно - заочная. Семестр 10.

1. Риски как экономическая категория. 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. 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. Математические модели и методы оценки риска: методы анализа операционных рисков предприятия; измерители и система показателей 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. 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. 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. 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. Экспертные методы оценки риска Метод статистической обработки результатов экспертизы.

Оценка согласованности мнений экспертов.

Разработал:
старший преподаватель
кафедры МЭО

Э.И. Казитова

Проверил:
Директор ИЭиУ

И.Н. Сычева