

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Кузбасский государственный технический университет имени Т. Ф. Горбачева»

Филиал КузГТУ в г. Новокузнецке

УТВЕРЖДАЮ

Директор филиала КузГТУ

в г. Новокузнецке

 Э.И. Забнева

«31» августа 2021 г.

Рабочая программа дисциплины

Оценка рисков

Направление подготовки / специальность 38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация / направленность (профиль) Экономико-правовое обеспечение
экономической безопасности

Присваиваемая квалификация
«Экономист»

Формы обучения
очная, очно-заочная

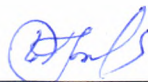
Новокузнецк 2021 г.

Рабочую программу составил:
кафедры ФК КузГТУ

Рабочая программа обсуждена на заседании
учебно-методического совета филиала КузГТУ в г. Новокузнецке

Протокол № 6 от 18.06.2021

Председатель УМС



подпись

Е.А. Нагрелли

Согласовано
Заместитель директора по УР



подпись

Е. А. Нагрелли

1 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине "Оценка рисков", соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Освоение дисциплины направлено на формирование:
обще профессиональных компетенций:

ОПК-2 - способностью использовать закономерности и методы экономической науки при решении профессиональных задач

профессиональных компетенций:

ПК-32 - способностью проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности

Результаты обучения по дисциплине определяются индикаторами достижения компетенций

Индикатор(ы) достижения:

Результаты обучения по дисциплине:

термины риск-менеджмента; сущность рисков, черты рисков, виды рисков; законы эвристики, правила риск-менеджмента; методы качественного и количественного анализа рисков; объектов, субъектов, цели и задачи управления рисками; процедуру процесса управления рисками; методы приема управленческих решений в условиях полной и частичной неопределенности; основные направления нивелирования рисков событий.

-

правовую основу финансовой деятельности в Российской Федерации на макро- и микроуровне выявлять основные факторы рисков; применять методы приема управленческих решений в условиях полной и частичной неопределенности; оценивать уровень риска по разным их видам, формировать комплексы мероприятий по управлению рисками.

-

оценивать затраты и результаты финансовой деятельности организации навыками количественной и качественной оценки рисков.
навыками ведения аналитической работы, способами сбора и анализа информации финансового состояния организации

2 Место дисциплины "Оценка рисков" в структуре ОПОП специалитета

Для освоения дисциплины необходимы знания умения, навыки и (или) опыт профессиональной деятельности, полученные в рамках изучения следующих дисциплин: Корпоративные финансы, Страхование, Экономическая безопасность, Экономический анализ.

«Оценка рисков» представляет собой дисциплину, формирующую базовые знания для усвоения дисциплин «Бюджетирование на предприятии», «Финансовый менеджмент», «Диагностика и прогнозирование угроз»

3 Объем дисциплины "Оценка рисков" в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся

Общая трудоемкость дисциплины "Оценка рисков" составляет 3 зачетных единицы, 108 часов.

Форма обучения	Количество часов		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Курс 4/Семестр 7			
Всего часов	108		
Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий):			
Аудиторная работа			
Лекции	16		



1550966542

Форма обучения	Количество часов		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Лабораторные занятия			
Практические занятия	34		
Внеаудиторная работа			
Индивидуальная работа с преподавателем:			
Консультация и иные виды учебной деятельности			
Самостоятельная работа	58		
Форма промежуточной аттестации	зачет		
Курс 5/Семестр 10			
Всего часов		108	
Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий):			
Аудиторная работа			
Лекции		4	
Лабораторные занятия			
Практические занятия		8	
Внеаудиторная работа			
Индивидуальная работа с преподавателем:			
Консультация и иные виды учебной деятельности			
Самостоятельная работа		92	
Форма промежуточной аттестации		зачет /4	

4 Содержание дисциплины "Оценка рисков", структурированное по разделам (темам)

4.1. Лекционные занятия

Неделя семестра	Раздел дисциплины (модуля), темы лекций и их содержание	Объем в часах	
		Очн.	Заочн.
1	1. Риск как экономическая категория, сущность риск-менеджмента [1-6] 1.1. Понятие и сущность риска. Возможные причины возникновения рисков. 1.2. Основные подходы к классификации рисков. 1.3. Сущность, цель и задачи риск-менеджмента. 1.4. Старая и новая парадигма риск-менеджмента.	2	0,5
3	2. Риск-менеджмент как процесс [1-6] 2.1. Этапы процесса управления риском: планирование управления рисками, идентификация рисков, анализ риска и приоритизация рисков, планирование действий для снижения вероятности рисков, мониторинг рисков, контроль рисков. 1. Постановка риск-менеджмента в организации	2	0,5
5	1. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности [1-6] 3.1. Система неопределенностей. Критерии определения оптимальности в сфере неопределенности. 3.2. Процедура подготовки, принятия и реализации управленческих решений. Зоны риска и ситуации неопределенности.	2	-
7	1. Оценка и анализ рисков [1-6] 4.1. Качественные методы оценки рисков. Метод экспертных оценок. Способы определения достоверности экспертных оценок. Метод Дельфи. Анализ финансового состояния предприятия. 4.2. Количественные методы оценки рисков. Статистический метод. Аналитические методы: анализ сценариев, упрощенные коэффициенты методы определения риска. 4.3. Специфические методы оценки рисков: метод достоверных эквивалентов; метод корректировки нормы дисконта; метод чувствительности β.	2	1



1550966542

9	5. Эвристика в риск-менеджменте [1-6] 5.1. Основы эвристики в риск-менеджменте. 5.2. Правила риск-менеджмента: максимум выигрыша, оптимальная вероятность результата, оптимальная колеблемость результата, оптимальное сочетание величины выигрыша и величины риска. 5.3. Способы принятия решений о рисковом вложении капитала.	2	-
11, 13, 15	6. Инструментарий риск-менеджмента [1-6] 6.1. Управление риском: возможности и последствия. Классификация методов управления рисками: передача, уклонение, локализация, диссипация, компенсация. 6.2. Возможности передачи риска: заключение контрактов; страхование как метод передачи рисков. 6.3. Уклонение от риска: отказ от ненадежных партнеров, отказ от рискованных проектов, страхование хозяйственных рисков, поиск гарантов. 6.4. Локализация: венчурные предприятия, создание специальных структурных подразделений (с обособленным балансом) для выполнения рискованных проектов, заключение договоров о совместной деятельности для реализации рискованных проектов. 6.5. Диссипация риска: диверсификация и ее возможности. 6.6. Компенсация риска: Самострахование. Хеджирование рисков. Секьюритизация рисков. 6.7. Оценка экономической эффективности страхования и самострахования (метод Хаустона)..	6	2
	Итого	16	4



1550966542

4.2. Практические (семинарские) занятия

Неделя семестра	Тема занятия	Объем в часах	
		Очн.	Заочн.
1-2	Риск как экономическая категория, сущность риск-менеджмента [1-6]	4	-
3-4	Риск-менеджмент как процесс [1-6]	4	-
5-6	Принятие управленческих решений в условиях неопределенности [1-6]	4	2
7-11	Оценка и анализ рисков [1-6]	10	2
12-13	Эвристика в риск-менеджменте [1-6]	4	2



1550966542

14-17	Инструментарий риск-менеджмента [1-6]	8	2
	Итого	34	8

4.3 Самостоятельная работа студента и перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

4.3.1. Очная форма обучения

Раздел дисциплины	№ недели	Вид СРС	Трудоемкость, ч
Тема 1-10	4	Выполнение домашнего задания 1 [1-6]	14,5
	8	Выполнение домашнего задания 2 [1-6]	14,5
	12	Выполнение домашнего задания 3 [1-6]	14,5
	16	Выполнение домашнего задания 4 [1-6]	14,5
Итого:			58

4.3.2. Заочная форма обучения

Раздел дисциплины	№ недели	Вид СРС	Трудоемкость, ч
Тема 1-8	1-12	Изучение теоретического материала [1-6]	72
	12-16	Выполнение контрольной работы	20
Итого:			92

5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине "Оценка рисков"

5.1 Паспорт фонда оценочных средств

№	Наименование разделов дисциплины	Содержание (темы) раздела	Код компетенции	Знания, умения, навыки, необходимые для формирования соответствующей компетенции	Форма текущего контроля знаний, умений, навыков, необходимых для формирования соответствующей компетенции



1550966542

1	Риск как экономическая категория. Риск-менеджмент как процесс	Сущность и виды рисков. Процесс управления рисками	ПК-32, ОПК-2	<p>Знать: термины риск-менеджмента; сущность рисков, черты рисков, виды рисков; объекты, субъекты, цели и задачи управления рисками; процедуру процесса управления рисками.</p> <p>Владеть: понятийным аппаратом изучаемой дисциплины</p> <p>Знать: правовую основу финансовой деятельности в Российской Федерации на макро- и микроуровне;</p> <p>Уметь: оценивать затраты и результаты финансовой деятельности организации;</p> <p>Владеть: навыками ведения аналитической работы, способами сбора и анализа информации финансового состояния организации.</p>	Контрольная работа № 1
---	---	--	--------------	--	------------------------



1550966542

2	Принятие управленческих решений в условиях неопределенности	Критерии принятия решений в условиях полной и частичной неопределенности	ПК-32, ОПК-2	<p>Знать: методы приема управленческих решений в условиях полной и частичной неопределенности;</p> <p>Уметь: применять методы приема управленческих решений в условиях полной и частичной неопределенности</p> <p>Знать: правовую основу финансовой деятельности в Российской Федерации на макро- и микроуровне;</p> <p>Уметь: оценивать затраты и результаты финансовой деятельности организации;</p> <p>Владеть: навыками ведения аналитической работы, способами сбора и анализа информации финансового состояния организации.</p>	Контрольная работа № 2
---	---	--	--------------	---	------------------------



1550966542

3	Оценка и анализ рисков	Методы качественного и количественного анализа рисков	ПК-32, ОПК-2	<p>Знать: методы качественного и количественного анализа рисков;</p> <p>Уметь: оценивать уровень риска по разным их видам;</p> <p>Владеть: навыками количественной и качественной оценки рисков</p> <p>Знать: правовую основу финансовой деятельности в Российской Федерации на макро- и микроуровне;</p> <p>Уметь: оценивать затраты и результаты финансовой деятельности организации;</p> <p>Владеть: навыками ведения аналитической работы, способами сбора и анализа информации финансового состояния организации.</p>	Контрольная работа № 3
---	------------------------	---	--------------	--	------------------------



1550966542

4	Инструментарий риск-менеджмента	Методу снижения рисков. Методы компенсации рисков. Методы передачи рисков	ПК-32, ОПК-2	Знать: основные направления нивелирования рисков событий; Уметь: формировать комплексы мероприятий по управлению рисками. Владеть: инструментарием риск-менеджмента. Знать: правовую основу финансовой деятельности в Российской Федерации на макро- и микроуровне; Уметь: оценивать затраты и результаты финансовой деятельности организации; Владеть: навыками ведения аналитической работы, способами сбора и анализа информации финансового состояния организации.	Коллоквиум № 1
---	---------------------------------	---	--------------	---	----------------

5.2. Типовые контрольные задания или иные материалы

5.2.1. Оценочные средства при текущей аттестации

Текущий контроль по дисциплине «Оценка рисков» включает в себя по ряду тем выполнение контрольной работы, по остающимся - коллоквиум.

Контрольная работа предполагает решение типовых задач. Примеры задач для контрольной работы:

1. Определитесь с потенциальным видом предпринимательской деятельности. Выявите виды рисков, присущие вашему проекту. Предложите собственную классификацию рисков проекта на основе выбранных Вами признаков. Используйте несколько характеристик, например, функциональные, структурные, временные и др. Обоснуйте выбор классификации. Постройте причинно-следственную диаграмму (диаграмму Исикавы) для идентифицированных рисков проекта.

2. Имеются два инвестиционных проекта. Первый проект с вероятностью 0,7 может обеспечить прибыль 10 млн. руб., а с вероятностью 0,3 можно потерять 3,5 млн. руб. Для второго проекта с вероятностью 0,8 можно получить прибыль 12 млн. руб. и с вероятностью 0,2 потерять 4 млн. руб. Какой проект выбрать? примените 2, 3 и 4 правила риск-менеджмента.

3. Проранжируйте организации по степени риска банкротства, выберете предполагаемого партнера. Весовые значения коэффициентов следующие: коэффициент текущей ликвидности 0,2; коэффициент оборачиваемости капитала 0,1; рентабельность активов 0,2; коэффициент независимости 0,2; доля собственного капитала в оборотных активах 0,1.

Значения финансовых коэффициентов	Организация					
	1	2	3	4	5	6
Коэффициент текущей ликвидности, долей ед.	1,8	2,0	1,5	1,7	1,4	1,6
Коэффициент оборачиваемости капитала, долей ед.	3,2	2,5	2,8	2,2	2,7	3,5



1550966542

Рентабельность активов, %	22	26	25	38	16	21
Коэффициент независимости, долей ед.	0,75	0,62	0,55	0,68	0,58	0,72
Доля собственного капитала в оборотных активах, %	16	26	25	30	10	35

Критерии оценивания контрольных работ студентов:

- «отлично», если студент справился более чем с 90% задания;
«хорошо», если студент справился с 70% задания;
«удовлетворительно», если студент справился более чем с 50% задания;
«неудовлетворительно», если студент справился менее чем с 50% задания.

Количество баллов	0...4,5	5...6,5	7...9	9,5...10
Шкала оценивания	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично

Вопросы для коллоквиума 1:

1. Методы снижения рисков: достоинства и недостатки; область применения.
2. Методы компенсации рисков: достоинства и недостатки; область применения.
3. Методы передачи рисков: достоинства и недостатки; область применения.
4. Универсальные приемы управления рисками.
5. Модель Хаутона: сущность, достоинства и недостатки, область применения.

Критерии оценивания коллоквиума:

- 10 баллов - при правильном и полном ответе на два вопроса;
8...9,5 баллов - при правильном и полном ответе на один из вопросов и правильном, но не полном ответе на другой из вопросов;
6...7,5 баллов - при правильном и неполном ответе на два вопроса или правильном и полном ответе только на один из вопросов;
2,5...5,5 баллов - при правильном и неполном ответе только на один из вопросов;
0...2 баллов - при отсутствии правильных ответов на вопросы.

Шкала оценивания:

Количество баллов	0...5,5	6...7,5	8...9,5	10
Шкала оценивания	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично

5.2.2 Оценочные средства при промежуточной аттестации

Промежуточная аттестация по дисциплине «Оценка рисков» проводится в соответствии с ОПОП и является обязательной. Формой промежуточной аттестации является зачет, в процессе которого определяется освоенность студентом компетенций, предусмотренных дисциплиной и рабочей программой ее изучения. Инструментом измерения освоения компетенций является правильность и полнота ответа студентом на контрольные вопросы.

Вопросы по закреплению теоретических знаний, умений и практических навыков, предусмотренных компетенциями:

1. Понятие риска. Основные черты рисков ситуации. Причины возникновения экономического риска.
1. Факторы, определяющие уровень рисков.
1. Классификация рисков.
1. Связь риска и доходности.
1. Этапы процесса управления риском.
1. Основные мероприятия политики управления рисками.
1. Система управления рисками.
1. Постановка риск-менеджмента в организации.
1. Правила и способы стратегии риск-менеджмента.
1. Принятие решений в условиях неопределенности.
1. Общеметодические подходы к качественной оценке риска. Метод экспертных оценок. Метод Дельфи.
1. Способы определения достоверности экспертных оценок. Коэффициент конкордации.
1. Количественные методы оценки рисков.
1. Уклонение от рисков.
1. Передача рисков.



1550966542

1. Локализация рисков.
1. Диссипация рисков.
1. Трансферт рисков.
1. Самострахование рисков.
1. Страхование рисков.
1. Хеджирование рисков с использованием различных финансовых инструментов.
1. Секьюритизация рисков.

Критерием оценки уровня сформированности компетенций в рамках учебной дисциплины «Оценка рисков» является зачёт:

зачтено	Оценка «отлично» - от 90 до 100 баллов - выставляется студенту, если он глубоко и прочно усвоил программный материал, исчерпывающе, последовательно, четко и логически стройно его излагает, умеет тесно увязывать теорию с практикой, свободно справляется с задачами, вопросами и другими видами применения знаний, причем не затрудняется с ответом при видоизменении заданий, правильно обосновывает принятое решение, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач.
	Оценка «хорошо» - от 80 до 89 баллов - выставляется студенту, если он твердо знает материал, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопрос, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения
	Оценка «удовлетворительно» - от 65 до 79 баллов - выставляется студенту, если он имеет знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, недостаточно правильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при выполнении практических работ.
не зачтено	Оценка «неудовлетворительно» - от 0 до 64 баллов - выставляется студенту, который не знает значительной части программного материала, допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями выполняет практические работы. Как правило, оценка «неудовлетворительно» ставится студентам, которые не могут продолжить обучение без дополнительных занятий по соответствующей дисциплине.

Шкала оценивания:

Количество баллов	0...64	65...79	80...89	90-100
Шкала оценивания	неудовл.	удовл.	хорошо	отлично

5.2.3. Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций

Суммарная оценка за текущий контроль складывается из оценок за отдельные виды работ, при этом учитывается их процентный вес, а именно:

Работа на практических занятиях (семинарах) - (опрос по контрольным вопросам темы, выполнение практических заданий, тестовых заданий)	30%
Посещение лекций/практических занятий	10%
Выполнение заданий по самостоятельной работе (эссе, домашние задания, доклады (рефераты))	35%
Дискуссии, кейс-стади, и другие активные методы обучения	15%
Активность на занятиях	10%
Итого:	100%

Итоговая оценка (зачет) выставляется с учетом:

- оценки за работу в семестре – оценки за текущий контроль (выполнение тестовых заданий, решения задач, написание эссе, участие в дискуссиях на семинарских занятиях и т.д.) – 60 %;
- оценки итоговых знаний в ходе зачета – 40 %.

6 Учебно-методическое обеспечение

6.1 Основная литература

1. Ерошенко, П. Д. Риски и неопределенность в менеджменте / П. Д. Ерошенко. – Москва : Лаборатория книги, 2012. – 97 с. – ISBN 9785504000268. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=140816 (дата обращения: 31.10.2021). – Текст : электронный.



1550966542

2. Савенкова, Е. В. Анализ и оценка рисков / Е. В. Савенкова ; Министерство образования и науки Российской Федерации. – Москва : Московский педагогический государственный университет (МПГУ), 2018. – 24 с. – ISBN 9785426306523. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=500526 (дата обращения: 31.10.2021). – Текст : электронный.

6.2 Дополнительная литература

1. Уколов, А. И. Оценка рисков / А. И. Уколов. – Москва : Директ-Медиа, 2018. – 627 с. – ISBN 9785447525897. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=445268 (дата обращения: 15.09.2021). – Текст : электронный.

2. Тихонов, Е. П. Риски в управлении предприятием / Е. П. Тихонов. – Москва : Лаборатория книги, 2011. – 134 с. – ISBN 9785504009872. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=142357 (дата обращения: 31.10.2021). – Текст : электронный.

3. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе: учебник и практикум для вузов / Касьяненко Т. Г., Маховикова Г. А.. – 2-е изд., пер. и доп. – Москва : Юрайт, 2021. – 381 с. – ISBN 978-5-534-00375-8. – URL: <https://urait.ru/book/analiz-i-ocenka-riskov-v-biznese-468977> (дата обращения: 27.06.2021). – Текст : электронный.

6.3 Методическая литература

6.4 Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Электронная библиотечная система «Университетская библиотека онлайн» <http://biblioclub.ru/>
2. Электронная библиотека КузГТУ https://elib.kuzstu.ru/index.php?option=com_content&view=article&id=230&Itemid=229
3. Справочная правовая система «КонсультантПлюс» <http://www.consultant.ru/>
4. Национальная электронная библиотека <https://rusneb.ru/>

6.5 Периодические издания

1. Финансовая экономика : всероссийский научно-аналитический журнал (электронный) <https://elibrary.ru/contents.asp?titleid=28699>
2. Финансовый директор : практический журнал по управлению финансами компании (печатный)
3. Финансы : теоретический и научно-практический журнал (печатный)
4. Экономист : научно-практический журнал (печатный)

7 Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

<http://www.riskovik.com/journal/>
<http://fd.ru/>
<http://www.profiz.ru/>

8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины "Оценка рисков"

Изучение дисциплины требует систематического и последовательного накопления знаний, поэтому пропуски лекций влияют на глубину освоения курса. В связи с чем студентам рекомендуется: 1) перед очередной лекцией просматривать материалы предыдущей лекции; 2) при затруднении в освоении материала обратитесь за разъяснениями либо к лектору, либо к основным источникам литературы по курсу.

Рекомендации при подготовке к практическим занятиям: 1) перед очередным практическим занятием прорабатывать теоретический материал соответствующий тематике занятия; 2) в начале занятий целесообразно задавать преподавателю вопросы по задачам, заданным для самостоятельного решения; 3) на занятии доводить каждую задачу до окончательного решения, демонстрируя понимание проведенных расчетов.

9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении



1550966542

образовательного процесса по дисциплине "Оценка рисков", включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем

Для изучения дисциплины может использоваться следующее программное обеспечение:

1. Google Chrome
2. Microsoft Windows
3. ESET NOD32 Smart Security Business Edition

10 Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине "Оценка рисков"

Желательно проведение лекций в аудиториях, оснащенных мультимедийным оборудованием.

11 Иные сведения и (или) материалы

В процессе освоения дисциплины «Оценка рисков» используются следующие образовательные технологии:

Стандартные методы обучения:

- лекции;
- практические занятия;
- решение задач;
- тестирование;
- обсуждение рефератов и докладов;
- письменные домашние работы;
- расчетно-аналитические задания;
- самостоятельная работа студентов;
- консультации преподавателей.

Методы обучения с применением интерактивных форм образовательных технологий:

1. «Мозговой штурм» (атака) (SWOT-анализ организации; кроссворд по курсу);
2. Приглашение специалиста с докладом «Идентификация рисков проекта» ;
3. «Составление ментальной карты» путем установление причинно-следственных связей возникновения рисков проекта;
4. Работа в группах (в т.ч. идентификация рисков проекта. построение диаграммы Исикавы); качественная оценка риска - определение согласованности мнений экспертов; оценка риска ликвидности организации; оценка риска финансовой неустойчивости организации; комплексная оценка финансовых рисков организации;
5. Решение ситуационных задач (в т.ч. оценка системы управления рисками в организации на примере ОАО «Магнитогорский металлургический комбинат»; оценка системы управления операционными рисками в крупной компании);
6. Контрольный лист по темам «Сущность риска»; «Виды рисков»; «Процесс управления рисками»; «Способы снижения степени рисков».



1550966542



1550966542

Список изменений литературы на 05.12.2017

Основная литература

1. Ерошенко, П. Д. Риски и неопределенность в менеджменте / П. Д. Ерошенко. – Москва : Лаборатория книги, 2012. – 97 с. – ISBN 9785504000268. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=140816 (дата обращения: 31.10.2021). – Текст : электронный.
2. Екатеринославский, Ю. Ю. Риски бизнеса / Ю. Ю. Екатеринославский, А. М. Медведева, С. А. Щенкова. – Москва : Анкил, 2010. – 280 с. – ISBN 9785864763094. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=257927 (дата обращения: 13.12.2020). – Текст : электронный.
3. Федорова, Е. А. Финансовая среда предпринимательства и предпринимательские риски : учебное пособие для студентов, обучающихся по специальности "Финансы и кредит", "Бухгалтерский учет, анализ и аудит" / Е. А. Федорова, Ф. М. Шелопаев, А. И. Ермоленко. – Москва : КноРус, 2010. – 360 с. – Текст : непосредственный.

Дополнительная литература

1. Воробьев, С. Н. Управление рисками / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. – Москва : Юнити, 2012. – 512 с. – ISBN 5238008619. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=117545 (дата обращения: 23.05.2021). – Текст : электронный.
2. Тихонов, Е. П. Риски в управлении предприятием / Е. П. Тихонов. – Москва : Лаборатория книги, 2011. – 134 с. – ISBN 9785504009872. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=142357 (дата обращения: 31.10.2021). – Текст : электронный.
3. Управление рисками фирмы : программы интегративного риск-менеджмента: пособие[Электронный ресурс]. – Москва : Финансы и статистика, 2006. – 400 с. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=225784 (дата обращения: 02.07.2019). – Текст : электронный.
4. Карбовский, В. Ф. Оценка рисков на рынке облигаций / В. Ф. Карбовский, (Жадан) О. С. Алексеева. – Москва : Экономика, 2011. – 152 с. – ISBN 9785282030891. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=65969 (дата обращения: 14.02.2021). – Текст : электронный.
5. Любушин, Н. П. Комплексный экономический анализ хозяйственной деятельности : учеб. пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности 060500 "Бухгалт. учет, анализ и аудит" / Н. П. Любушин. – 3-е изд., перераб. и доп. – Москва : ЮНИТИ-ДАНА, 2006. – 448 с. – Текст : непосредственный.



1550966542

УТВЕРЖДАЮ

Директор филиала КузГТУ

в г. Новокузнецке

Э. И. Забнева

«31» августа 2021

Изменения рабочей программы

Оценка рисков

Направление подготовки 38.05.01 Экономическая безопасность

Профиль Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

3 Объем дисциплины «Оценка рисков» в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам занятий) и на самостоятельную работу обучающихся.

Общая трудоемкость дисциплины «Оценка рисков» составляет 3 зачетные единицы, 108 часов

Форма обучения	Количество часов		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
<i>Курс 4/Семестр 7</i>			
<i>Всего часов</i>	108		
Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий):			
Аудиторная работа			
<i>Лекции</i>	16		
<i>Лабораторные занятия</i>			
<i>Практические занятия</i>	34		
Внеаудиторная работа			
<i>Индивидуальная работа с преподавателем:</i>			
<i>Консультации и иные виды учебной деятельности</i>			
<i>Самостоятельная работа</i>	58		
<i>Форма промежуточной аттестации</i>	Зачет		
<i>Курс 5/Семестр 10</i>			
<i>Всего часов</i>		108	
Контактная работа обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий):			
Аудиторная работа			
<i>Лекции</i>		4	4
<i>Лабораторные занятия</i>			
<i>Практические занятия</i>		8	8
Внеаудиторная работа			
<i>Индивидуальная работа с преподавателем:</i>			

Консультации и иные виды учебной деятельности			
Самостоятельная работа		92	96
Форма промежуточной аттестации		Зачет /4	Зачет

4 Содержание дисциплины «Оценка рисков», структурированное по разделам (темам)

4.1. Лекционные занятия

Раздел дисциплины, темы лекций и их содержание	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
1. Риск как экономическая категория, сущность риск менеджмента 1.1. Понятие и сущность риска. Возможные причины возникновения рисков. 1.2. Основные подходы к классификации рисков. 1.3. Сущность, цель и задачи риск-менеджмента. 1.4. Старая и новая парадигма риск-менеджмента.	2	0,5	0,5
2. Риск-менеджмент как процесс 2.1. Этапы процесса управления риском: планирование управления рисками, идентификация рисков, анализ риска и приоритизация рисков, планирование действий для снижения вероятности рисков, мониторинг рисков, контроль рисков. Постановка риск-менеджмента в организации	2	0,5	0,5
3. Принятие управленческих решений в условиях неопределенности 3.1. Система неопределенностей. Критерии определения оптимальности в сфере неопределенности. 3.2. Процедура подготовки, принятия и реализации управленческих решений. Зоны риска и ситуации неопределенности.	2	1	1
4. Оценка и анализ рисков 4.1. Качественные методы оценки рисков. Метод экспертных оценок. Способы определения достоверности экспертных оценок. Метод Дельфи. Анализ финансового состояния предприятия. 4.2. Количественные методы оценки рисков. Статистический метод. Аналитические методы: анализ сценариев, упрощенные коэффициентные методы определения риска. 4.3. Специфические методы оценки рисков: метод достоверных эквивалентов; метод корректировки нормы дисконта; метод чувствительности	2	0,25	0,25
5. Эвристика в риск-менеджменте 5.1. Основы эвристики в риск-менеджменте. 5.2. Правила риск-менеджмента: максимум выигрыша, оптимальная вероятность результата, оптимальная колеблемость результата, оптимальное сочетание величины выигрыша и величины риска. 5.3. Способы принятия решений о рисковом вложении капитала.	2	0,25	0,25
6. Инструментарий риск-менеджмента 6.1. Управление риском: возможности и последствия. Классификация методов управления рисками: передача, уклонение, локализация, диссипация, компенсация. 6.2. Возможности передачи риска: заключение контрактов; страхование как метод передачи рисков. 6.3. Уклонение от риска: отказ от ненадежных партнеров, отказ от рискованных проектов, страхование хозяйственных рисков, поиск гарантов. 6.4. Локализация: венчурные предприятия, создание специальных структурных подразделений (с обособленным балансом) для выполнения рискованных проектов, заключение договоров о совместной деятельности для	6	1,5	1,5

реализации рискованных проектов. 6.5. Диссипация риска: диверсификация и ее возможности. 6.6. Компенсация риска: Самострахование. Хеджирование рисков. Секьюритизация рисков. 6.7. Оценка экономической эффективности страхования и самострахования (метод Хаустона)			
Итого	16	4	4

4.2 Практические (семинарские) занятия

Раздел дисциплины, темы лекций и их содержание	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Риск как экономическая категория, сущность риск-менеджмента	4	2	2
Риск-менеджмент как процесс	4	2	2
Принятие управленческих решений в условиях неопределенности	4	1	1
Оценка и анализ рисков	10	1	1
Эвристика в риск-менеджменте	4	1	1
Инструментарий риск-менеджмента	8	1	1
Итого	34	8	8

4.3 Самостоятельная работа обучающегося и перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине «Оценка рисков»

Вид СРС	Трудоемкость в часах		
	ОФ	ЗФ	ОЗФ
Выполнение домашнего задания 1	14,5		
Выполнение домашнего задания 2	14,5		
Выполнение домашнего задания 3	14,5		
Выполнение домашнего задания 4	14,5		
Изучение теоретического материала		72	72
Выполнение контрольной работы		20	24
Итого	58	92	96

Список изменений литературы на 30.08.2021
Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения
дисциплины «Оценка рисков»

6.1 Основная литература

1. Уколов, А. И. Оценка рисков : учебник : [16+] / А. И. Уколов. – 3-е изд., стер. – Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2021. – 550 с. : ил., табл. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=599010> (дата обращения:28.08.21). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-4499-1673-0. – DOI 10.23681/599010. – Текст: электронный
2. 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:28.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-8158-2097-5. – Текст: электронный.
3. 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:28.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-238-03413-3. – Текст : электронный.

6.2 Дополнительная литература

1. Тихонов, Е. П. Риски в управлении предприятием / Е. П. Тихонов. – Москва : Лаборатория книги, 2011. – 134 с. – ISBN 9785504009872. – URL: http://biblioclub.ru/index.php?page=book_red&id=142357 (дата обращения:28.08.2021). – Текст: электронный.
2. Касьяненко, Т. Г. Анализ и оценка рисков в бизнесе: учебник и практикум для вузов / Касьяненко Т. Г., Маховикова Г. А.. – 2-е изд., пер. и доп. – Москва : Юрайт, 2021. – 381 с. – ISBN 978-5-534-00375-8. – URL: <https://urait.ru/book/analiz-i-ocenka-riskov-v-biznese-468977> (дата обращения:28.08.2021). – Текст : электронный.
3. Каранина, Е. В. Управление рисками: механизмы, инструменты, профессиональные стандарты : учебник : [16+] / Е. В. Каранина. – Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2020. – 257 с. : ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576521> (дата обращения:28.08.2021). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-4499-1161-2. – DOI 10.23681/576521. – Текст : электронный.

6.3 Методическая литература

1. Методические рекомендации по организации учебной деятельности обучающихся КузГТУ / ФГБОУ ВО «Кузбас. гос. техн. ун-т им. Т. Ф. Горбачева», Каф. приклад. информ. технологий ; сост. Л. И. Михалева. – Кемерово : КузГТУ, 2017. – 32 с. – URL: <http://library.kuzstu.ru/meto.php?n=553> (дата обращения: 18.07.2021). – Текст : электронный.

7. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»
ЭИОС Филиала КузГТУ в г. Новокузнецке:

- а) Библиотека Филиала КузГТУ в г. Новокузнецке : [сайт] / Филиала КузГТУ в г. Новокузнецке. –Новокузнецк : КузГТУ, [б. г.]. – URL: <http://lib.kuzstu-nf.ru> / (дата обращения: 11.01.2021). – Текст:электронный.
- б) Портал филиала КузГТУ в г. Новокузнецке: Автоматизированная Информационная Система (АИС): [сайт] / Филиала КузГТУ в г. Новокузнецке. – Новокузнецк : КузГТУ, [б. г.]. – URL: <http://portal.kuzstu-nf.ru> / (дата обращения: 11.01.2021). – Режим доступа: для авториз. пользователей. – Текст: электронный.
- в) Электронное обучение : Филиала КузГТУ в г. Новокузнецке. –Новокузнецк : КузГТУ, [б. г.]. – URL: <http://158.46.252.206/moodle> / (дата обращения: 11.01.2021). – Режим доступа: для авториз. пользователей Филиала КузГТУ. – Текст: электронный.

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

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа, курсового проектирования (выполнения курсовых работ), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации.

Помещения для самостоятельной работы, оснащенные компьютерной техникой с

возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспеченные доступом в электронную информационно-образовательную среду филиала.

11 Иные сведения и (или) материалы

1. Образовательный процесс осуществляется с использованием как традиционных, так и современных интерактивных технологий.

В рамках аудиторных занятий применяются следующие интерактивные методы:

- разбор конкретных примеров;
- мультимедийная презентация.

2. Проведение групповых и индивидуальных консультаций осуществляется в соответствии с расписанием консультаций по темам, заявленным в рабочей программе дисциплины, в период освоения дисциплины и перед промежуточной аттестацией с учетом результатов текущего контроля.