

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Сыров Игорь Анатольевич  
Должность: Директор  
Дата подписания: 30.10.2023 12:01:18  
Уникальный программный ключ:  
b683afe664d7e9f64175886cf9626a198149ad36

СТЕРЛИТАМАКСКИЙ ФИЛИАЛ  
ФЕДЕРАЛЬНОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО БЮДЖЕТНОГО ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО  
УЧРЕЖДЕНИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«УФИМСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ НАУКИ И ТЕХНОЛОГИЙ»

Факультет  
Кафедра

*Экономический*  
*Экономической теории и анализа*

**Аннотация рабочей программы дисциплины (модуля)**

дисциплина ***ФТД.В.ДВ.01.02 Оценка и управление экономическими рисками на предприятии***

часть, формируемая участниками образовательных отношений

Специальность

**38.05.01**

***Экономическая безопасность***

код

наименование специальности

Программа

***Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности***

Форма обучения

**Очная**

Для поступивших на обучение в  
**2022 г.**

Стерлитамак 2023

**1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с установленными в образовательной программе индикаторами достижения компетенций**

<b>Формируемая компетенция (с указанием кода)</b>	<b>Код и наименование индикатора достижения компетенции</b>	<b>Результаты обучения по дисциплине (модулю)</b>
ПК-1. Способен разработать интегрированную систему управления рисками	ПК-1.1. Применяет современные информационные системы и технологии управления рисками	<p>Обучающийся должен:</p> <p>Знать различные способы выявления внешнего и внутреннего контекста функционирования хозяйствующего субъекта</p> <p>Уметь определять различные способы выявления внешнего и внутреннего контекста функционирования хозяйствующего субъекта</p> <p>Владеть навыками использования различных способов выявления внешнего и внутреннего контекста функционирования хозяйствующего субъекта</p>
	ПК-1.2. Выявляет недостатки существующей системы управления рисками и разрабатывает рекомендации по улучшению процедур	<p>Обучающийся должен:</p> <p>Знать современные информационные системы и технологии управления рисками</p> <p>Уметь использовать современные информационные системы и технологии управления рисками</p> <p>Владеть современными информационными системы и технологиями управления рисками</p>
	ПК-1.3. Осуществляет мониторинг наиболее критичных рисков, их динамики и вырабатывает рекомендаций по дальнейшему развитию системы управления рисками	<p>Обучающийся должен:</p> <p>Знать стратегические, оперативные цели и задачи системы оценки и управления рисками</p> <p>Уметь применять стратегические, оперативные цели и задачи в оценке и управлении экономическими рисками на предприятии</p> <p>Владеть навыками использования стратегических, оперативных целей и задач в оценке и управлении экономическими рисками на предприятии</p>

## 2. Цели и место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Цели изучения дисциплины:

ознакомление студентов с теоретическими основами проблемы оценки экономических рисков на предприятии и применения полученных при этом знаний в своей практической деятельности.

Дисциплина изучается на 2 курсе в 3 семестре

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

Общая трудоемкость (объем) дисциплины составляет 72 акад. ч.

Объем дисциплины	Всего часов
	Очная форма обучения
Общая трудоемкость дисциплины	72
Учебных часов на контактную работу с преподавателем:	
лекций	16
практических (семинарских)	16
другие формы контактной работы (ФКР)	0,2
Учебных часов на контроль (включая часы подготовки):	
зачет	
Учебных часов на самостоятельную работу обучающихся (СР)	39,8

Формы контроля	Семестры
зачет	3

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

### 4.1. Разделы дисциплины и трудоемкость по видам учебных занятий (в академических часах)

№ п/п	Наименование раздела / темы дисциплины	Виды учебных занятий, включая самостоятельную работу обучающихся и трудоемкость (в часах)			
		Контактная работа с преподавателем			СР
		Лек	Пр/Сем	Лаб	
1	Теоретические основы оценки рисков на предприятия	6	6	0	18
1.1	Риски как экономическая категория	2	2	0	10
1.2	Анализ и оценки риска в системе управления предприятием	2	2	0	4
1.3	Направления оптимизации рисков предприятия	2	2	0	4

<b>2</b>	<b>Методологические основы оценки рисков на предприятии</b>	<b>10</b>	<b>10</b>	<b>0</b>	<b>21,8</b>
2.1	Методы анализа и оценки рисков предприятия	2	2	0	4
2.2	Методы оценки рисков в условиях неопределенности	2	2	0	4
2.3	Организация управления рисками на предприятии	4	2	0	6
2.4	Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска	2	4	0	7,8
	<b>Итого</b>	<b>16</b>	<b>16</b>	<b>0</b>	<b>39,8</b>

#### 4.2. Содержание дисциплины, структурированное по разделам (темам)

Курс лекционных занятий

№	Наименование раздела / темы дисциплины	Содержание
<b>1</b>	<b>Теоретические основы оценки рисков на предприятии</b>	
1.1	Риски как экономическая категория	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Сущность и виды рисков предприятия.</li> <li>2. Риск как экономическая категория и его сущность.</li> <li>3. Понятие неопределенности и риска.</li> <li>4. Основные виды неопределенностей в экономической деятельности.</li> <li>5. Классификация рисков.</li> <li>6. Основные черты риска.</li> <li>7. Факторы риска. Природа риска.</li> </ol>
1.2	Анализ и оценки риска в системе управления предприятием	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Управление рисками предприятия.</li> <li>2. Характеристика основных элементов системы управления рисками предприятия.</li> <li>3. Алгоритм управления рисками предприятия.</li> <li>4. Методы управления рисками: принципы управления, алгоритм управления.</li> <li>5. Процесс управления операционными рисками.</li> </ol>
1.3	Направления оптимизации рисков предприятия	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Объект управления рисками как научной дисциплины, цели и задачи.</li> <li>2. Актуальные направления оптимизации рисков предприятия.</li> <li>3. Оптимизация риска, как следствие внешнего воздействия на организацию.</li> <li>4. Концепция конфликта целей в организации</li> <li>5. Подходы к определению понятия «оптимизация риска» в организации</li> </ol>
<b>2</b>	<b>Методологические основы оценки рисков на предприятии</b>	
2.1	Методы анализа и оценки рисков предприятия	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Методы анализа рисков.</li> <li>2. Формализация частичной неопределенности и применение теории вероятности в задачах оценки риска.</li> </ol>

		3.Закон нормального распределения; интервальная оценка риска. 4.Статистические показатели риска: среднее значение, выборочная средняя, математическое ожидание, стандартное отклонение, дисперсия, доверительный интервал, коэффициент вариации. 5.Предельные значения показателей риска
2.2	Методы оценки рисков в условиях неопределенности	1. Критерии количественной оценки риска в условиях неопределенности: критерий Сэвиджа; критерий Гурвица; критерий Вальда; критерий Байеса. 2. Выбор решений в условиях частичной неопределенности: критерий рациональности Лапласа.
2.3	Организация управления рисками на предприятии	1. Понятие, цели, принципы, функции и этапы разработки системы управления совокупным риском предприятия. 2. Этапы разработки системы управления риском. 3. Требования к системе управления рисками на предприятии
2.4	Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска	1. Информационное обеспечение как способ уменьшения экономического риска. 2. Стоимость (ценность) информации. 3. Диверсификация как способ уменьшения риска: понятия, преимущества и границы применения. 4. Диверсификация финансовых активов: условия применения и оценка эффекта. 6.Фонды рискованного финансирования как форма минимизации риска. 7.Страхование как способ снижения риска. Критерии целесообразности страхования. 8. Хеджирование как способ ограничения риска операций с ценными бумагами. 9. Пути снижения внутренних предпринимательских рисков.

#### Курс практических/семинарских занятий

№	Наименование раздела / темы дисциплины	Содержание
<b>1</b>	<b>Теоретические основы оценки рисков на предприятии</b>	
1.1	Риски как экономическая категория	1. Риск как экономическая категория и его сущность. 2. Понятие неопределенности и риска. 3. Основные черты риска. 4. Факторы риска. Природа риска
1.2	Анализ и оценки риска в	1. Управление рисками предприятия.

	системе управления предприятием	<ol style="list-style-type: none"> <li>2. Характеристика основных элементов системы управления</li> <li>3. рисками предприятия.</li> <li>4. Алгоритм управления рисками предприятия.</li> <li>5. Методы управления рисками: принципы управления, алгоритм управления.</li> <li>6. Процесс управления операционными рисками</li> </ol>
1.3	Направления оптимизации рисков предприятия	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Объект управления рисками как научной дисциплины, цели и задачи.</li> <li>2. Актуальные направления оптимизации рисков предприятия.</li> <li>3. Оптимизация риска, как следствие внешнего воздействия на организацию.</li> <li>4. Концепция конфликта целей в организации</li> <li>5. Подходы к определению понятия «оптимизация риска» в организации</li> </ol>
<b>2</b>	<b>Методологические основы оценки рисков на предприятии</b>	
2.1	Методы анализа и оценки рисков предприятия	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Методы анализа рисков.</li> <li>2. Формализация частичной неопределенности и применение теории вероятности в задачах оценки риска.</li> <li>3. Закон нормального распределения; интервальная оценка риска.</li> <li>4. Статистические показатели риска: среднее значение, выборочная средняя, математическое ожидание, стандартное отклонение, дисперсия, доверительный интервал, коэффициент вариации.</li> <li>5. Предельные значения показателей риска</li> </ol>
2.2	Методы оценки рисков в условиях неопределенности	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Теория матричных игр в оценке риска: матрица последствий и матрица рисков.</li> <li>2. Критерии количественной оценки риска в условиях неопределенности: критерий Сэвиджа; критерий Гурвица; критерий Вальда; критерий Байеса.</li> <li>3. Выбор решений в условиях частичной неопределенности: критерий рациональности Лапласа.</li> </ol>
2.3	Организация управления рисками на предприятии	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Понятие, цели, принципы, функции и этапы разработки системы управления совокупным риском предприятия.</li> <li>2. Этапы разработки системы управления риском.</li> </ol>
2.4	Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Информационное обеспечение как способ уменьшения экономического риска.</li> <li>2. Стоимость (ценность) информации.</li> <li>3. Диверсификация как способ уменьшения риска: понятия, преимущества и границы применения.</li> </ol>

	<p>4. Диверсификация производственной и коммерческой деятельности: возможности применения и оценка результативности.</p> <p>5. Диверсификация финансовых активов: условия применения и оценка эффекта.</p> <p>6. Фонды рискованного финансирования как форма минимизации риска.</p> <p>7. Страхование как способ снижения риска. Критерии целесообразности страхования.</p> <p>8. Хеджирование как способ ограничения риска операций с ценными бумагами.</p> <p>9. Пути снижения внутренних предпринимательских рисков.</p>
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------