

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Сыров Игорь Анатольевич
Должность: Директор
Дата подписания: 30.10.2023 11:47:47
Уникальный программный ключ:
b683afe664d7e9f64175886cf9626a196149ad36

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

Факультет
Кафедра

Экономический
Экономической теории и анализа

Рабочая программа 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

2023 г.

Разработчик (составитель)

к.э.н., доцент

Алтынбаева Л. Е.

ученая степень, должность, ФИО

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с установленными в образовательной программе индикаторами достижения компетенций	3
2. Цели и место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы	4
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	4
4. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и видов учебных занятий.....	4
4.1. Разделы дисциплины и трудоемкость по видам учебных занятий (в академических часах).....	4
4.2. Содержание дисциплины, структурированное по разделам (темам)	5
5. Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю).....	8
6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)	9
6.1. Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)	9
6.2. Перечень электронных библиотечных систем, современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем	10
6.3. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства	10
7. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)	11

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

Формируемая компетенция (с указанием кода)	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине (модулю)
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

2	Методологические основы оценки рисков на предприятии	10	10	0	21,8
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
	Итого	16	16	0	39,8

4.2. Содержание дисциплины, структурированное по разделам (темам)

Курс лекционных занятий

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

		<p>3. Закон нормального распределения; интервальная оценка риска.</p> <p>4. Статистические показатели риска: среднее значение, выборочная средняя, математическое ожидание, стандартное отклонение, дисперсия, доверительный интервал, коэффициент вариации.</p> <p>5. Предельные значения показателей риска</p>
2.2	Методы оценки рисков в условиях неопределенности	<p>1. Критерии количественной оценки риска в условиях неопределенности: критерий Сэвиджа; критерий Гурвица; критерий Вальда; критерий Байеса.</p> <p>2. Выбор решений в условиях частичной неопределенности: критерий рациональности Лапласа.</p>
2.3	Организация управления рисками на предприятии	<p>1. Понятие, цели, принципы, функции и этапы разработки системы управления совокупным риском предприятия.</p> <p>2. Этапы разработки системы управления риском.</p> <p>3. Требования к системе управления рисками на предприятии</p>
2.4	Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска	<p>1. Информационное обеспечение как способ уменьшения экономического риска.</p> <p>2. Стоимость (ценность) информации.</p> <p>3. Диверсификация как способ уменьшения риска: понятия, преимущества и границы применения.</p> <p>4. 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>

Курс практических/семинарских занятий

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

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

	<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>
--	---

5. Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

Учебно-методическое обеспечение для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине (модулю)

1.1. Риски как экономическая категория

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Основные виды неопределенностей в экономической деятельности.
- 2) Классификация рисков

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам.

1.2. Анализ и оценки риска в системе управления предприятием.

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Методы управления рисками: принципы управления, алгоритм управления.
- 2) Процесс управления операционными рисками

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам.

1.3. Направления оптимизации рисков предприятия. .

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Подходы к определению понятия «оптимизация риска» в организации

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам.

1.4. Методы анализа и оценки рисков предприятия

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- Метод избегания рисков.
- Метод принятия рисков на себя. .
- Метод предотвращения убытков.
- Метод уменьшения размера убытков.

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам.

2.1. Организация управления рисками на предприятии

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Функции и этапы разработки системы управления совокупным риском предприятия.

Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам.

2.2. Механизм управления риском, способы и средства снижения экономического риска

Вопросы для самостоятельного рассмотрения:

- 1) Хеджирование как способ ограничения риска операций с ценными бумагами.
 - 2) Пути снижения внутренних предпринимательских рисков.
- Контроль СР: Выборочный опрос студентов по рассмотренным вопросам.

Список учебно-методических материалов, необходимых для организации самостоятельного изучения тем дисциплины «Оценка и управление экономическими рисками на предприятии».

1. Каранина, Е. В. Управление рисками: механизмы, инструменты, профессиональные стандарты : [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: 18.05.2023)
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: 18.05.2023)
3. Балдин, К. В. Управление рисками : учебное пособие / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. – Москва : Юнити-Дана, 2017. – 511 с. : ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. –
URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=615795> (дата обращения: 01.06.2021)
4. Кудрявцев, А. А. Введение в количественный риск-менеджмент : учебник : [16+] / А. А. Кудрявцев, А. В. Радионов ; Санкт-Петербургский государственный университет. – Санкт-Петербург : Издательство Санкт-Петербургского Государственного Университета, 2016. – 192 с. – Режим доступа: по подписке. –
URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=457952> (дата обращения: 18.05.2023)

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

6.1. Перечень учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

Основная учебная литература:

1. Балдин, К. В. Управление рисками : учебное пособие / К. В. Балдин, С. Н. Воробьев. – Москва : Юнити-Дана, 2017. – 511 с. : ил., табл., схем. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=615795> (дата обращения: 13.05.2023)
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: 13.05.2023)
3. Каранина, Е. В. Управление рисками: механизмы, инструменты, профессиональные стандарты : [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: 13.05.2023)

Дополнительная учебная литература:

1. Каранина, Е. В. Риск-менеджмент : учебник : [12+] / Е. В. Каранина. – Москва ; Берлин : Директ-Медиа, 2020. – 190 с. : табл., ил., схем. – Режим доступа: по

подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=576201> (дата обращения: 13.05.2023)

2. Ласкина, Л. Ю. Оценка и управление рисками в инновационной деятельности : учебное пособие : [16+] / Л. Ю. Ласкина, Л. В. Силакова ; Университет ИТМО. – Санкт-Петербург : Университет ИТМО, 2019. – 68 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=566785> (дата обращения: 13.05.2023)

6.2. Перечень электронных библиотечных систем, современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем

№ п/п	Наименование документа с указанием реквизитов
1	Договор на доступ к ЭБС ZNANIUM.COM между БашГУ в лице директора СФ БашГУ и ООО «Знаниум» № 3/22-эбс от 05.07.2022
2	Договор на доступ к ЭБС «ЭБС ЮРАЙТ» (полная коллекция) между БашГУ в лице директора СФ БашГУ и ООО «Электронное издательство ЮРАЙТ» № 1/22-эбс от 04.03.2022
3	Договор на доступ к ЭБС «Университетская библиотека онлайн» между БашГУ и «Нексмедиа» № 223-950 от 05.09.2022
4	Договор на доступ к ЭБС «Лань» между БашГУ и издательством «Лань» № 223-948 от 05.09.2022
5	Договор на доступ к ЭБС «Лань» между БашГУ и издательством «Лань» № 223-949 от 05.09.2022
6	Соглашение о сотрудничестве между БашГУ и издательством «Лань» № 5 от 05.09.2022
7	ЭБС «ЭБ БашГУ», бессрочный договор между БашГУ и ООО «Открытые библиотечные системы» № 095 от 01.09.2014 г.
8	Договор на БД диссертаций между БашГУ и РГБ № 223-796 от 27.07.2022
9	Договор о подключении к НЭБ и о предоставлении доступа к объектам НЭБ между БашГУ в лице директора СФ БашГУ с ФГБУ «РГБ» № 101/НЭБ/1438-П от 11.06.2019
10	Договор на доступ к ЭБС «ЭБС ЮРАЙТ» (полная коллекция) между УУНиТ в лице директора СФ УУНиТ и ООО «Электронное издательство ЮРАЙТ» № 1/23-эбс от 03.03.2023

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет» (далее - сеть «Интернет»)

№ п/п	Адрес (URL)	Описание страницы
1	https://naukaru.ru/ru/nauka/journal/55/view#archie	"Журнал экономических исследований"

6.3. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства

Наименование программного обеспечения
Windows XP Лицензионное соглашение MSDN. Государственный контракт №9 от 18.03.2008 г. ЗАО «СофтЛайн»
Office Standart 2010 RUS OLP NL Acsmc 200 /Лицензионный договор №04297 от 9.04.2012

7. Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Тип учебной аудитории	Оснащенность учебной аудитории
Читальный зал: помещение для самостоятельной работы	Учебная мебель, учебно-наглядные пособия, компьютеры с доступом к сети «Интернет» и ЭИОС Филиала
Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, учебная аудитория для проведения практических работ, учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций, учебная аудитория текущего контроля и промежуточной аттестации.	учебная мебель, доска, мультимедиа-проектор, экран настенный, учебно-наглядные пособия
Учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, учебная аудитория для проведения практических работ, учебная аудитория для проведения групповых и индивидуальных консультаций, учебная аудитория текущего контроля и промежуточной аттестации; аудитория, оборудованная для проведения занятий по информационным технологиям; компьютерный класс с доступом к сети "Интернет" и электронной информационно-образовательной среде СФ УУНиТ. Учебная аудитория курсового проектирования (выполнения курсовых работ)	учебная мебель, доска, мультимедиа-проектор, экран настенный, компьютеры