

## Аннотация к рабочей программы дисциплины Б1.В.О4 «АНАЛИЗ И ОЦЕНКА РИСКОВ»

**Объем трудоемкости:** 2 зачетных единицы

### **Цель освоения дисциплины**

Целью дисциплины «Анализ и оценка рисков» является формирование целостного представления о методах анализа и оценки возможных экономических рисков, теоретических основ и практических навыков в области организации и управления рисками в деятельности хозяйствующих субъектов, разработки экономически эффективных финансовых и инвестиционных решений.

### **Задачи дисциплины:**

- изучить причины возникновения, сущность, факторы, принципы и особенности экономических рисков;
- изучить основные положения, инструменты, методы анализа и оценки риска;
- освоить методы и инструменты анализа и техники оценки возможных экономических рисков для управления организациями и инвестиционными проектами;
- приобрести навыки анализа и количественной оценки рисков, в том числе при реализации инвестиционных проектов;
- получить навыки распределения рисков реализации инвестиционного проекта между всеми участниками проекта;
- получить навыки оказания методической помощи сотрудникам в выявлении и оценке рисков.

### **Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы**

Дисциплина «Анализ и оценка рисков» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана. В соответствии с рабочим учебным планом дисциплина изучается в 4 семестре 2 курса по очной и в 4 семестре 2 курса по очно-заочной форме обучения. Вид промежуточной аттестации: зачет.

Изучение дисциплины базируется на знаниях, полученных в результате освоения дисциплин «Статистика», «Экономика организации (предприятия)» в частности на умение проводить статистический анализ данных, использовать различные методы оценки взаимосвязи изучаемых признаков, знание различных терминов и показателей экономики организаций.

Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, применяются при изучении таких дисциплин как «Финансовая статистика», «Риск-менеджмент», «Оценка бизнеса», «Инвестиционный менеджмент».

### **Требования к уровню освоения дисциплины**

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Код и наименование индикатора* достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
<b>ПК-3 Способен разрабатывать отдельные функциональные направления управления рисками</b>	Знает основные положения, инструменты, методы анализа и оценки риска; Знает факторы рисков, принципы, особенности и техники их оценки
<b>ИПК-3.2</b> Разрабатывает и использует методы и техники анализа рисков с учётом оценки влияния различных факторов	Умеет организовать и провести сбор информации, необходимой для выявления основных факторов риска и оценки его уровня, систематизировать массивы полученных данных; Умеет экономически обоснованно использовать методы снижения рисков для управления организациями и инвестиционными проектами.

Код и наименование индикатора* достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
	Осуществляет анализ и количественную оценку рисков, в том числе при реализации инвестиционных проектов; Планирует распределения рисков реализации инвестиционного проекта между всеми участниками проекта и оказывает методическую помощь сотрудникам в выявлении и оценке рисков.
<b>ПК- 4 Способен осуществлять подготовку инвестиционного проекта</b>	Знает основные положения, инструменты, методы анализа и оценки риска; Знает факторы рисков, принципы, особенности и техники их оценки
ИПК - 4.2 Разрабатывает и использует методы и техники анализа рисков с учётом оценки влияния различных факторов	Умеет организовать и провести сбор информации, необходимой для выявления основных факторов риска и оценки его уровня, систематизировать массивы полученных данных; Умеет экономически обоснованно использовать методы снижения рисков для управления организациями и инвестиционными проектами.
	Осуществляет анализ и количественную оценку рисков, в том числе при реализации инвестиционных проектов; Планирует распределения рисков реализации инвестиционного проекта между всеми участниками проекта и оказывает методическую помощь сотрудникам в выявлении и оценке рисков.

#### Содержание дисциплины:

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в 4 семестре (*очная форма обучения*)

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1.	Сущность и функции экономического риска	7,8	2	2	-	3,8
2.	Методы идентификации риска	10	4	2	-	4
3.	Расчетно-аналитические методы оценки риска	12	2	4	-	6
4.	Статистические и вероятностные методы оценки риска	14	4	4	-	6
5.	Использование показателей теории игр для принятия оптимальных организационно-управленческих решений	8	2	2	-	4
6.	Экспертные методы оценки риска	8	2	2	-	4
7.	Комбинированные методы оценки риска	8	2	2	-	4
	<i>ИТОГО по разделам дисциплины</i>	67,8	18	18	-	31,8
	Контроль самостоятельной работы (КСР)	4	-	-	-	-
	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,2	-	-	-	-
	Подготовка к экзамену	-	-	-	-	-
	Общая трудоемкость по дисциплине	72	18	18	-	31,8

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия / семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

**Курсовые работы:** не предусмотрена

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** зачет

Автор



---

канд. экон. наук, доцент кафедры ЭАСиФ  
Тимченко А.И.