

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Центр бакалавриата Экономика



УТВЕРЖДАЮ

Проректор по образовательной деятельности КФУ

Проф. Д.А. Гаурский

ДЕПАРТАМЕНТ
ОБРАЗОВАНИЯ
(ДО КФУ)

» _____ 20__ г.

подписано электронно-цифровой подписью

Программа дисциплины
Анализ и оценка рисков Б1.В.ОД.24

Направление подготовки: 38.03.01 - Экономика

Профиль подготовки: Экономика предприятий и организаций

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Автор(ы):

Нурыйахметова С.М.

Рецензент(ы):

Махиянова А.В.

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий(ая) кафедрой: Демьянова О. В.

Протокол заседания кафедры No ____ от " ____ " _____ 201__ г

Учебно-методическая комиссия Института управления, экономики и финансов (центр бакалавриата: экономика):

Протокол заседания УМК No ____ от " ____ " _____ 201__ г

Регистрационный No 950042418

Казань
2018

Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. (доцент) Нурыйахметова С.М. кафедра экономики и производства Высшая школа Открытый институт инновационного, технологического и социального развития , Svetanur-agni@mail.ru

1. Цели освоения дисциплины

Целью изучения дисциплины является обучение студентов теоретическим основам и практическим приемам компьютерного моделирования рисков предприятия в целях принятия обоснованных управленческих решений.

В результате изучения дисциплины студенты должны:

- знать методологию построения и применения экономико-математических моделей анализа и оценки рисков;
- владеть приемами формализованного представления экономико-математических моделей поставленных задач в оценке риска;
- использовать современное программное обеспечение для решения задач моделирования рисков в деятельности предприятия.

2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел "Б1.В.ОД.24 Дисциплины (модули)" основной образовательной программы 38.03.01 Экономика и относится к обязательным дисциплинам. Осваивается на 4 курсе, 8 семестр.

Дисциплина "Анализ и оценка рисков" включена в раздел Б3.ДВ1 профессионального цикла дисциплин и относится к вариативной части, устанавливаемой вузом по выбору. Данная дисциплина осваивается на четвертом курсе (7 семестр).

Изучению курса "Анализ и оценка рисков" предшествует освоение таких дисциплин, как: "Моделирование деятельности предприятий и организаций" "Математический анализ", "Экономико-математические модели", "Информационные системы в экономике", "Финансовая математика", "Организация производства".

Данная дисциплина способствует освоению следующих дисциплин: "Бизнес-планирование", "Финансовое планирование и бюджетирование", "Планирование затрат и себестоимости продукции", "Организация бизнес-процессов предприятия".

Знания по курсу "Анализ и оценка рисков" необходимы при подготовке и написании бакалаврской работы для разработки и апробации экономико-математических моделей с целью более глубокого раскрытия темы и обоснования предложенных в работе выводов и рекомендаций.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-1 (профессиональные компетенции)	способность обобщать и критически оценивать отечественный и зарубежный опыт и составлять процесс анализа рисков ситуаций
ПК-10 (профессиональные компетенции)	способность использовать для решения аналитических и исследовательских задач в области моделирования современные технические средства и информационные технологии
ПК-2 (профессиональные компетенции)	способность обосновывать выбранные методы анализа и оценки рисков

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-3 (профессиональные компетенции)	способность проводить самостоятельные исследования в области анализа и оценки рисков ситуаций
ПК-4 (профессиональные компетенции)	способность предоставлять результаты научного исследования в виде доклада или презентации
ПК-5 (профессиональные компетенции)	способность самостоятельно применять основные методы анализа и оценки рисков и разрабатывать управленческие решения на основе выбранного критерия при наличии определенных ограничений и с учетом факторов неопределенности
ПК-6 (профессиональные компетенции)	способность на основе изучения теоретических и методических подходов к анализу и оценке рисков, строить модели и применять полученные знания на практике
ПК-7 (профессиональные компетенции)	способность анализировать и интерпретировать полученные результаты моделирования и принимать управленческие решения на основе анализа результатов решения применяемых моделей
ПК-8 (профессиональные компетенции)	способность применять аналитические методы в области принятия стратегических решений на макро- и микроуровне
ПК-9 (профессиональные компетенции)	владеть основными методами, способами и средствами получения, хранения, переработки информации, навыками работы с компьютером как средством управления информацией, способность работать с информацией в глобальных компьютерных сетях

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

- основные положения и принципы анализа и оценки риска;
- проблемные вопросы выбора вида модели для моделирования рисков ситуаций в деятельности предприятия;
- особенности применения математических методов и модели в теории управления рисками;

2. должен уметь:

- применять современный математический инструментарий для анализа и оценки рисков событий;
- использовать современное программное обеспечение для решения экономических задач оценки риска;
- формализовать экономико- математическую модель оценки различных видов рисков.

3. должен владеть:

Практическими навыками:

- сравнительного анализа и применимости методов оценки рисков;
- использования приемов моделирования рисков ситуаций в условиях недостаточности информации, неопределенности и трудно формализуемых задач.
- самостоятельного экономико- математического моделирования рисков ситуаций.

4. должен демонстрировать способность и готовность:

- применять полученные знания на практике и в научно-исследовательской работе;
- принимать управленческие решения на основе анализа результатов решения применяемых моделей

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет зачетных(ые) единиц(ы) 108 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины: экзамен в 8 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

Тематический план дисциплины/модуля

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
1.	Тема 1. Риски как экономическая категория	8		4	4	0	Реферат Дискуссия
2.	Тема 2. Анализ и оценки риска в системе управления предприятием	8		4	2	0	Дискуссия
3.	Тема 3. Измерители и показатели производственных рисков	8		2	4	0	Дискуссия
4.	Тема 4. Методы анализа и оценки рисков предприятия	8		4	4	0	Устный опрос
5.	Тема 5. Методы оценки рисков в условиях неопределенности	8		4	6	0	Устный опрос
6.	Тема 6. Основы формирования оптимального портфеля ценных бумаг	8		4	4	0	Устный опрос

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
7.	Тема 7. Экспертные методы оценки риска	8		4	4	0	Контрольная работа
	Тема . Итоговая форма контроля	7		0	0	0	Экзамен
	Итого			26	28	0	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Риски как экономическая категория

лекционное занятие (4 часа(ов)):

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.

практическое занятие (4 часа(ов)):

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.

Тема 2. Анализ и оценки риска в системе управления предприятием

лекционное занятие (4 часа(ов)):

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.

практическое занятие (2 часа(ов)):

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.

Тема 3. Измерители и показатели производственных рисков

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Математические модели и методы оценки риска: методы анализа операционных рисков предприятия; измерители и система показатели 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.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Математические модели и методы оценки риска: методы анализа операционных рисков предприятия; измерители и система показатели 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.

Тема 4. Методы анализа и оценки рисков предприятия

лекционное занятие (4 часа(ов)):

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.

практическое занятие (4 часа(ов)):

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.

Тема 5. Методы оценки рисков в условиях неопределенности

лекционное занятие (4 часа(ов)):

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.

практическое занятие (6 часа(ов)):

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.

Тема 6. Основы формирования оптимального портфеля ценных бумаг

лекционное занятие (4 часа(ов)):

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.

практическое занятие (4 часа(ов)):

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.

Тема 7. Экспертные методы оценки риска

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Экспертные методы оценки риска Метод статистической обработки результатов экспертизы. Оценка согласованности мнений экспертов

практическое занятие (4 часа(ов)):

Экспертные методы оценки риска Метод статистической обработки результатов экспертизы. Оценка согласованности мнений экспертов

4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
1.	Тема 1. Риски как экономическая категория	8		подготовка к выполнению реферата	4	реферат
				подготовка к дискуссии	4	Дискуссия

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
2.	Тема 2. Анализ и оценки риска в системе управления предприятием	8		подготовка к дискуссии	8	дискуссия
3.	Тема 3. Измерители и показатели производственных рисков	8		подготовка к дискуссии	6	Дискуссия
				подготовки к дискуссии	2	дискуссия
4.	Тема 4. Методы анализа и оценки рисков предприятия	8		подготовка к устному опросу	2	Устный опрос
5.	Тема 5. Методы оценки рисков в условиях неопределенности	8		подготовка к устному опросу	2	Устный опрос
6.	Тема 6. Основы формирования оптимального портфеля ценных бумаг	8		подготовка к устному опросу	4	Устный опрос
7.	Тема 7. Экспертные методы оценки риска	8		подготовка к контрольной работе	4	Контрольная работа
	Итого				36	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

Освоение дисциплины "Анализ и оценка рисков" предполагает использование как традиционных (лекции, практические занятия с использованием методических материалов), так и инновационных образовательных технологий с использованием в учебном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий: занятия в компьютерных аудиториях; мультимедиа.

6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Тема 1. Риски как экономическая категория

Дискуссия , примерные вопросы:

Риск и неопределенность. Основные виды неопределенностей в экономической деятельности. Классификация рисков. Основные черты риска. Факторы риска. Природа риска.

реферат , примерные темы:

3. Операционный риск и его составляющие: факторы риска; основные черты риска; природа риска.

Тема 2. Анализ и оценки риска в системе управления предприятием

дискуссия , примерные вопросы:

1.Раскройте сущность основных принципов управления рисками на предприятии? 2.Какова роль информационной составляющей в системе анализа и управления рисками? 3.Каковы источники формирования информационной базы в системе анализа и оценки рисков?

Тема 3. Измерители и показатели производственных рисков

Дискуссия , примерные вопросы:

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.

дискуссия , примерные вопросы:

1. Какова сущность анализа чувствительности? 2. Какова система показателей риска? Назовите основные относительные показатели оценки риска. 4. Какова сущность количественного и качественного анализа операционных рисков? 5. Каковы основные абсолютные показатели оценки риска?

Тема 4. Методы анализа и оценки рисков предприятия

Устный опрос , примерные вопросы:

Методы анализа рисков

Тема 5. Методы оценки рисков в условиях неопределенности

Устный опрос , примерные вопросы:

Процесс управления операционными рисками Выбор решений в условиях частичной неопределенности

Тема 6. Основы формирования оптимального портфеля ценных бумаг

Устный опрос , примерные вопросы:

Инвестиционный эффективный портфель

Тема 7. Экспертные методы оценки риска

Контрольная работа , примерные вопросы:

Задание 1. Дать письменный ответ на вопросы по вариантам (вариант выбирается студентом по последней цифре в зачетной книжке) Вариант 1. Тема: Понятие риска и неопределенности 1. Определение неопределенности. Факторы неопределенности 2. Подходы к определению риска 3. Взаимосвязь неопределенности и риска 4. Функции риска в экономике Вариант 2. Тема: Классификация и характеристика рисков 1. Классификация рисков. Подходы к классификации рисков 2. Характеристика основных видов риска 3. Сущность качественного анализа риска 4. Финансовый риск 5. Производственный риск Вариант 3. Тема: Классификация и характеристика рисков 1. Инвестиционный риск 2. Процентные риски (факторы, виды, снижение рисков) 3. Кредитные риски (факторы, виды, снижение рисков) 4. Инфляционный риск 5. Валютные риски (факторы, виды, снижение рисков) 6. Риск ликвидности 7. Риск активов Вариант 4. Тема: Информация и риск 1. Роль информации в анализе рисков 2. Источники информации 3. Требования к качеству информации 4. Оценка качества информации 5. Приобретение дополнительной информации Вариант 5. Тема: Вероятностная оценка риска 1. Понятие о ряде распределения и законах распределения 2. Идентификация закона распределения случайной величины 3. Критерии согласия Пирсона, Колмогорова и т.д. 4. Определение вероятности риска с использованием ППП Excel Вариант 6. Тема: Статистические методы оценки риска 1. Временные ряды. Моделирование временных рядов 2. Коэффициент колеблемости как показатель риска 3. Оценка риска на основе коэффициента вариации 4. Оценка риска на основе корреляционно-регрессионного анализа 5. Оценка риска на основе кластерного анализа 6. Выбор оптимального решения с помощью статистических оценок Вариант 7. Тема: Управление рисками в системе менеджмента предприятия 1. Объект и субъект управления рисками 2. Основные задачи при управлении рисками 3. Схема процесса управления риском 4. Оценка эффективности управления рисками Вариант 8. Тема: Методы управления рисками: диверсификация, страхование, хеджирование 1. Выбор приемов управления риском 2. Диверсификация 3. Страхование риска: сущность, преимущества и недостатки. Самострахование 4. Хеджирование: сущность, преимущества и недостатки 5. Опционы, форвардные и фьючерсные контракты 6. Лимитирование 7. Личностные факторы, влияющие на степень риска при принятии управленческих решений 8. Роль руководителя в принятии рискованных решений Вариант 9. Тема: Оценка риска в условиях неопределенности. Экспертные методы оценки риска 1. Оценка риска на основе субъективной вероятности 2. Сущность экспертного анализа рисков 3. Алгоритм экспертного анализа рисков 4. Методы обработки информации 5. Анализ экспертной информации Вариант 10. Тема: Критерии принятия решений в условиях неопределенности 1. Методы принятия эффективных решений в условиях неопределенности 2. Понятие игры с природой 3. Предмет теории игр. Основные понятия 4. Выбор решений при наличии многокритериальных альтернатив Задание 2. Оценить уровень риска (по выбору студента): урожайности, инвестиций, курса акций, производства мяса, прибыли предприятия и т.п.) с использованием статистических методов.

Итоговая форма контроля

экзамен

Примерные вопросы к экзамену:

Вопросы к экзамену

1. Риск как экономическая категория.
2. Понятие неопределенности и риска.
3. Анализ ситуации и его роль в оценке риска.
4. Количественные методы оценки риска
5. Классификация рисков.
6. Статистические показатели оценивания уровня риска.
7. Точечная оценка риска в условиях частичной неопределенности.
8. Кривая риска потерь и методы построения кривой риска.
9. Количественные характеристики риска и методы их определения.
10. Применение теории вероятности в оценке риска.
11. Теория игр в оценке риска и выбор решений в условиях неопределенности.
12. Оценка риска и в условиях частичной неопределенности.

13. Экспертные методы в оценке риска.
14. Метод анкетирования.
15. "Роза" и спираль рисков.
16. Метод "Дельфи".
17. Методы статистической обработки результатов экспертизы.
18. Количественные характеристики инвестиционного эффективного портфеля.
19. Методы и модели управления риском инвестиционного портфеля
20. Портфель Марковица минимального риска: формализация экономико -математической модели, интерпретация результатов решения.

Типовые задачи к экзамену

1. Пусть ожидаемый доход по активу "X" имеет распределение со средним значением 20% и стандартным отклонением 30%. Текущая цена актива составляет 100 млн. долл. Необходимо на конец года:

- рассчитать и построить график функции распределения $F(x)$ на интервале от 0 до 240 млн. долл.;

- оценить вероятность того, что убыток к концу года составит более 20 млн. долл. (вероятность цены актива меньше 80 млн. долл.);

Результаты расчетов представить графически.

2. Среднемесячный доход бизнеса предпринимателя составляет 600 тыс. руб. со стандартным отклонением 40 тыс. руб. Какова вероятность того, что доходность окажется:

-менее 550 тыс. руб;

-от 550 до 700 тыс. руб.

- минимальный доход дают 2% сделок. Какова их величина?

3. По известной платежной матрице (эффектов), представленной в таблице 1, необходимо построить матрицу рисков и выбрать альтернативные решения без учета данных о вероятности отдельных ситуаций, но с учетом ожидаемых значений вероятности реализации той или иной ситуации $p_1=0,1$; $p_2=0,25$; $p_3=0,3$; $p_4=0,15$; $p_5=0,2$.

4. Среднемесячная доходность бизнеса составляет 600 тыс. руб. со стандартным отклонением 30 тыс. руб. Какова вероятность того, что доходность окажется:

-от 550 до 600 тыс. руб.

- минимальный доход дают 3% сделок. Какова их величина?

5. Среднемесячный доход бизнеса составляет 600 тыс. руб. со стандартным отклонением 30 тыс. руб. Какова вероятность того, что доход окажется:

- менее 800 тыс. руб.;

-менее 550 тыс. руб;

-от 550 до 600 тыс. руб.

- минимальный доход дают 3% сделок. Какова их величина?

6. Среднемесячный доход бизнеса составляет 600 тыс. руб. со стандартным отклонением 30 тыс. руб. Какова вероятность того, что доход окажется:

-менее 550 тыс. руб;

-от 550 до 700 тыс. руб.

Представьте результаты расчета в графическом виде.

7. Среднемесячный доход бизнеса составляет 600 тыс. руб. со стандартным отклонением 30 тыс. руб. Какова вероятность того, что доход окажется:

-менее 550 тыс. руб;

-от 550 до 500 тыс. руб.

Представьте результаты расчета в графическом виде.

7.1. Основная литература:

Теория риска и моделирование рисков ситуаций, Шапкин, Александр Сергеевич; Шапкин, В.А., 2010г.

Риск-анализ в экономике, Тихомиров, Николай Петрович; Тихомирова, Татьяна Михайловна, 2010г.

Экономические и финансовые риски, Шапкин, Александр Сергеевич; Шапкин, Виктор Александрович, 2013г.

Управление рисками на предприятии, Васин, Сергей Михайлович; Шутов, В.С., 2010г.

Оценка и перераспределение рисков в производственной деятельности предприятий нефтегазового сервиса, Королева, Екатерина Александровна, 2009г.

Инвестиции, Орлова, Елена Роальдовна, 2008г.

1. Воробьев, С. Н. Управление рисками в предпринимательстве [Электронный ресурс] / С. Н. Воробьев, К. В. Балдин. - 4-е изд., испр. - М. : Издательско-торговая корпорация "Дашков и Ко", 2013. - 482 с., <http://znanium.com/go.php?id=430664>

2. Управление рисками предприятия: Учеб. пособие / В.Н. Уродовских. - М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2010., <http://znanium.com/go.php?id=201227>

3. Бочаров С.А. Риск-менеджмент: учебно-методический комплекс / С.А. Бочаров, А.А. Иванов, С.Я. Олейников. - М.: Изд. центр ЕАОИ, 2011. - 304 с., <http://www.bibliorossica.com/book.html?currBookId=6515>

7.2. Дополнительная литература:

Управление финансовыми проектами и финансовыми рисками, Горбачев, Сергей Викторович; Тумашев, Айдар Равильевич, 2011г.

Хозяйственные риски: теория и способы регулирования, Дресвянникова, Анна Владимировна, 2009г.

Управление рисками, Малаев, Владимир Валентинович, 2011г.

1. Анализ и управление рисками организации: Учебное пособие / Н.А. Рыхтикова. - 2-е изд. - М.: Форум, 2009. - 240 с., <http://znanium.com/go.php?id=195189>

2. Лугинин О.Е., Фомишина В.Н. Экономико-математические методы и модели: теория и практика с решением задач: учеб пособие.- РнД: "Феникс" -2009.

3. Попов А.М., Сотников В.Н. Экономико- математические методы и модели/ Под ред. А.М. Попова: учебник. - М.: Юрайт.- 2011.

4. Орлова Е.Р. Инвестиции: учеб. пособие. -М.: Омега -Л , 2012.

5. Балдин К.В., Передеряев И.И., Голов Р.С. Инвестиции в инновации: учеб. пособие.- М.: Дашков и К, 2012.

6. Логинов В.Н. Управленческие решения: модели и методы: учеб. пособие.-М.: Альфа-Пресс.- 2011.

7. Беннинга Ш. Финансовое моделирование с использованием Excel. -2-е изд.: Пер. с англ.-М.:Вильямс, 2007г.

7.3. Интернет-ресурсы:

Информационная база Гарант - www.garant.ru

Информационная база Консультант - www.consultant.ru

Научная библиотека им. Н.И. Лобачевского - <http://kpfu.ru/library>

Портал БиблиоРоссика - www.bibliorossica.ru

Электронно-библиотечная система КнигаФонд - www.knigafund.ru

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Анализ и оценка рисков" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Мультимедийная аудитория, вместимостью более 60 человек. Мультимедийная аудитория состоит из интегрированных инженерных систем с единой системой управления, оснащенная современными средствами воспроизведения и визуализации любой видео и аудио информации, получения и передачи электронных документов. Типовая комплектация мультимедийной аудитории состоит из: мультимедийного проектора, автоматизированного проекционного экрана, акустической системы, а также интерактивной трибуны преподавателя, включающей тач-скрин монитор с диагональю не менее 22 дюймов, персональный компьютер (с техническими характеристиками не ниже Intel Core i3-2100, DDR3 4096Mb, 500Gb), конференц-микрофон, беспроводной микрофон, блок управления оборудованием, интерфейсы подключения: USB, audio, HDMI. Интерактивная трибуна преподавателя является ключевым элементом управления, объединяющим все устройства в единую систему, и служит полноценным рабочим местом преподавателя. Преподаватель имеет возможность легко управлять всей системой, не отходя от трибуны, что позволяет проводить лекции, практические занятия, презентации, вебинары, конференции и другие виды аудиторной нагрузки обучающихся в удобной и доступной для них форме с применением современных интерактивных средств обучения, в том числе с использованием в процессе обучения всех корпоративных ресурсов. Мультимедийная аудитория также оснащена широкополосным доступом в сеть интернет. Компьютерное оборудование имеет соответствующее лицензионное программное обеспечение.

Компьютерный класс, представляющий собой рабочее место преподавателя и не менее 15 рабочих мест студентов, включающих компьютерный стол, стул, персональный компьютер, лицензионное программное обеспечение. Каждый компьютер имеет широкополосный доступ в сеть Интернет. Все компьютеры подключены к корпоративной компьютерной сети КФУ и находятся в едином домене.

1. Компьютерные классы с выходом в Интернет.
2. Аудитории, оборудованные мультимедийными средствами обучения

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 38.03.01 "Экономика" и профилю подготовки Экономика предприятий и организаций .

Автор(ы):

Нурияхметова С.М. _____

"__" _____ 201__ г.

Рецензент(ы):

Махиянова А.В. _____

"__" _____ 201__ г.